

Warszawa, 24 sierpnia 2020 r.

Szanowni Państwo,

W imieniu AgioFunds Towarzystwa Funduszy Inwestycyjnych S.A. przekazujemy Państwu sprawozdanie finansowe BETA ETF mWIG40TR Portfelowego Funduszu Inwestycyjnego Zamkniętego (dalej „Fundusz”) za okres sprawozdawczy od 1 stycznia 2020 r. do 30 czerwca 2020 r.

W sprawozdaniu finansowym zawarte są szczegółowe informacje na temat składu portfela lokat, struktury kosztów oraz rezultaty operacji finansowych. Do sprawozdania finansowego załączony jest raport niezależnego biegłego rewidenta z przeglądu półrocznego sprawozdania finansowego, oraz oświadczenie banku depozytariusza o zgodności stanu aktywów Funduszu.

Na koniec okresu sprawozdawczego wartość aktywów netto na jeden certyfikat inwestycyjny Funduszu (dalej „Certyfikat”) wynosiła 48,12 zł według wyceny bilansowej, co oznaczało spadek o 6,06 zł, czyli o – 11,19% w stosunku do wartości aktywów netto na Certyfikat na dzień 31 grudnia 2019 r., tj. na koniec poprzedniego roku obrotowego, wynoszącej 54,18 zł. W rozpatrywanym okresie, pod koniec lutego, miało miejsce załamanie na rynkach akcji spowodowane wybuchem pandemii COVID-19, które w dniu 16 marca 2020r. doprowadziło do tego, iż Certyfikaty zanotowały swoją najniższą historycznie wycenę aktywów netto na Certyfikat wynoszącą 38,31 zł, tracąc w ten sposób w relacji do 31 grudnia 2019r. - 29,30%. Pomimo znaczącej poprawy sytuacji na rynkach akcji po dniu 16 marca 2020r., Certyfikatom nie udało się osiągnąć poziomów sprzed wybuchu pandemii. W całym okresie sprawozdawczym maksymalna wartość aktywów netto na Certyfikat wynosiła 56,79 zł i miała miejsce w dniu 5 lutego 2020r., natomiast maksymalna wartość aktywów netto na Certyfikat, która miała miejsce po historycznym minimum z dnia 16 marca 2020r., to 50,07 zł z 23 czerwca 2020r., co odpowiadało spadkowi o -11,83% w relacji do najwyższej wartości z okresu sprawozdawczego i jednocześnie wzrostowi o 30,71% w stosunku do historycznego minimum z 16 marca 2020r.

Wartość aktywów netto na dzień 30 czerwca 2020r. wynosiła 110 009 tys. zł, co odpowiadało 2 286 213 Certyfikatom. W porównaniu do analogicznych wartości na koniec poprzedniego roku obrotowego wynoszących odpowiednio 78 458 tys. zł i 1 448 100 Certyfikatów, aktywa netto wzrosły w okresie sprawozdawczym o ponad 40,21%, co spowodowane było przede wszystkim silnym wzrostem liczby Certyfikatów o 57,88%. W okresie tym wyemitowano łącznie 838 113 Certyfikatów, natomiast nie miały miejsca wykupy Certyfikatów.

W całym okresie sprawozdawczym nie wystąpiły przypadki wystąpienia trudności w realizacji strategii inwestycyjnej określonej w statucie i nie miały miejsca jakiegokolwiek naruszenia limitów inwestycyjnych tam określonych. Stopa zwrotu certyfikatu inwestycyjnego w okresie sprawozdawczym wyniosła wspomniane -11,19% przy stopie zwrotu indeksu równej -10,67%, co odpowiadało wartości różnicy odwzorowania na poziomie -0,52%. Wartość błędu odwzorowania dla całego okresu sprawozdawczego wyniosła zaś zaledwie 0,39%. Łączna ekspozycja netto Funduszu wynosiła w tym okresie przeciętnie 99,92% i wahała się w przedziale pomiędzy 98,08% a 100,33%, czyli w przedziale znacząco niższym od statutowego wynoszącego od 95% do 105%.

Dziękujemy Państwu za możliwość kontynuacji zarządzania Państwa środkami poprzez nasz Fundusz. Jednocześnie zachęcamy Państwa do zapoznania się z informacjami zawartymi w niniejszym sprawozdaniu. Zawarte w nim informacje pozwolą Państwu w pełni poznać realizowaną politykę inwestycyjną.

Mariusz Jagodziński
Prezes Zarządu

*/podpisano kwalifikowanym
podpisem elektronicznym/*

Wojciech Somerski
Wiceprezes Zarządu

*/podpisano kwalifikowanym
podpisem elektronicznym/*

Marcin Grabowski
Członek Zarządu

*/podpisano kwalifikowanym
podpisem elektronicznym/*