

Warszawa, 13 kwietnia 2021 r.

Szanowni Państwo,

W imieniu AgioFunds Towarzystwa Funduszy Inwestycyjnych S.A. przekazujemy Państwu sprawozdanie finansowe BETA ETF WIG20short Portfelowego Funduszu Inwestycyjnego Zamkniętego (dalej „Fundusz”) za okres sprawozdawczy od 24 października 2019 r. do 31 grudnia 2020 r.

W sprawozdaniu finansowym zawarte są szczegółowe informacje na temat składu portfela lokat, struktury kosztów oraz rezultaty operacji finansowych. Do sprawozdania finansowego załączone jest sprawozdanie niezależnego biegłego rewidenta z badania rocznego 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 365,49 zł według wyceny bilansowej, co oznacza wzrost o 1,79 zł (+0,49%) w stosunku do wartości z dnia 7 listopada 2019r. (czyli od pierwszego dnia zainwestowania środków i jednocześnie pierwszego Dnia Wyceny) wynoszącej 363,70 zł. Celem inwestycyjnym Funduszu jest odwzorowywanie stóp zwrotu indeksu odniesienia WIG20short, który w analogicznym okresie zyskał 3,44% co oznacza, że różnica odwzorowania wyniosła -2,944%. Fundusz pobiera opłatę za zarządzanie w wysokości 1,00%, więc w porównaniu do funduszy segmentu akcji polskich jest to opłata niska.

BETA ETF WIG20short cieszył się znacznym zainteresowaniem inwestorów. Wartość aktywów netto Funduszu od dnia 7 listopada do dnia 31 grudnia 2020r. uległa zwiększeniu o 15,74 mln zł i na koniec roku wyniosła 20,77 mln zł. W tym samym okresie na GPW obrót Certyfikatami wyniósł 205,73 mln zł., natomiast liczba transakcji wyniosła 18 471. W okresie tym liczba Certyfikatów wzrosła o 43 002 z poziomu 13 815 do 56 817 co daje wzrost liczby wyemitowanych Certyfikatów o ok. 311%.

Polityka inwestycyjna BETA ETF WIG20short opiera się na stosowaniu syntetycznej replikacji indeksu WIG20 (Indeks Bazowy) z uwzględnieniem stopnia dźwigni finansowej replikowanego indeksu WIG20short, czyli na zawieraniu odpowiednich krótkich pozycji w kontraktach futures na WIG20. Od 7 listopada 2019r. do końca grudnia 2020 r. średni poziom ekspozycji na Indeks Bazowy kształtował się na poziomie -99,91% i pochodził wyłącznie z tytułu ekspozycji wynikającej z kontraktów terminowych futures na WIG20. W całym okresie sprawozdawczym nie wystąpiły trudności w realizacji strategii inwestycyjnej określonej w statucie.

Dziękujemy Państwu za możliwość kontynuacji zarządzania Państwa środkami poprzez BETA ETF WIG20short. Jednocześnie zachęcamy Państwa do zapoznania się z informacjami zawartymi w niniejszym sprawozdaniu. Zawarte w nim informacje pozwolą Państwu w pełni poznać realizowaną politykę inwestycyjną.

Z poważaniem,

Mariusz Jagodziński  
Prezes Zarządu

*/podpisano kwalifikowanym  
podpisem elektronicznym/*

Wojciech Somerski  
Wiceprezes Zarządu

*/podpisano kwalifikowanym  
podpisem elektronicznym/*

Marcin Grabowski  
Członek Zarządu

*/podpisano kwalifikowanym  
podpisem elektronicznym/*