

skorygowany

KOMISJANADZORUFINANSOWEGO

Raport kwartalny FIZ-Q-E

za 2 kwartał 2021 roku obejmujący okres od 2021-04-01 do 2021-06-30

podstawa prawna:

§ 60 ust. 1 pkt 1 - kwartalne sprawozdanie finansowe FIZ_E

Data przekazania: 2021-08-04

BETA ETF S&P 500 PLN-HEDGED PORTFELOWY FUNDUSZ INWESTYCYJNY ZAMKNIĘTY			
(pełna nazwa funduszu)			
BETA ETF S&P 500 PLN-HEDGED PORTFELOWY FIZ		AGIOFUNDS TOWARZYSTWO FUNDUSZY INWESTYCYJNYCH S.A.	
(skrótowa nazwa funduszu)		(nazwa towarzystwa)	
00-057	WARSZAWA		
(kod pocztowy)	(miejsowość)		
PL. DĄBROWSKIEGO		1	(numer)
(ulica)			
(22) 531-54-54	(22) 531-54-55	agiofunds@agiofunds.pl	
(telefon)	(fax)	(e-mail)	
	388291560	www.agiofunds.pl	
(NIP)	(REGON)	(WWW)	

KOMISJANADZORUFINANSOWEGO

Informacje o funduszu

Konstrukcja funduszu:		Typ funduszu:	
Subfundusz:	<input type="checkbox"/>	Fundusz sekurytyzacyjny:	<input type="checkbox"/>
Fundusz podstawowy:	<input type="checkbox"/>	Fundusz portfelowy:	<input checked="" type="checkbox"/>
Fundusz powiązany:	<input type="checkbox"/>	Fundusz aktywów niepublicznych:	<input type="checkbox"/>
		Waluta sprawozdania finansowego:	zł

	(nazwa funduszu podstawowego)
Fundusze powiązane:	
	(nazwy funduszy powiązanych)
Fundusz z wydzielonymi subfunduszami:	
	(nazwa funduszu)

Plik	Opis
Wprowadzenie_do_sprawozdania.pdf	Wprowadzenie do sprawozdania

WYBRANE DANE FINANSOWE	Wartość na dzień bilansowy w tys.	Wartość wyrażona w EURO
I. Przychody z lokat	25	5
II. Koszty funduszu netto	56	12
III. Przychody z lokat netto	-31	-7
IV. Zrealizowane zyski (straty) ze zbycia lokat	483	106
V. Niezrealizowane zyski (straty) z wyceny lokat	-5	-1
VI. Wynik z operacji	447	98
VII. Zobowiązania	65	14
VIII. Aktywa	5 338	1 181
IX. Aktywa netto	5 267	1 165
X. Liczba zarejestrowanych certyfikatów inwestycyjnych	71 505	71 505
XI. Wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny	73,66	16,29
XII. Wynik z operacji na certyfikat inwestycyjny	6,25	1,37

ZESTAWIENIE LOKAT

SKŁADNIKI LOKAT	2 kwartał			1 kwartał		
	2021 roku			2021 roku		
	Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem	Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
1. Akcje	0	0	0,00	0	0	0,00
2. Warranty subskrypcyjne	0	0	0,00	0	0	0,00
3. Prawa do akcji	0	0	0,00	0	0	0,00
4. Prawa poboru	0	0	0,00	0	0	0,00
5. Kwity depozytowe	0	0	0,00	0	0	0,00
6. Listy zastawne	0	0	0,00	0	0	0,00
7. Dłużne papiery wartościowe	0	0	0,00	0	0	0,00
8. Instrumenty pochodne	0	-5	-0,10	0	-23	-0,47
9. Udziały w spółkach z ograniczoną odpowiedzialnością	0	0	0,00	0	0	0,00
10. Jednostki uczestnictwa	0	0	0,00	0	0	0,00
11. Certyfikaty inwestycyjne	0	0	0,00	0	0	0,00
12. Tytuły uczestnictwa emitowane przez instytucje w spólnego inwestowania mające siedzibę za granicą	0	0	0,00	0	0	0,00
13. Wierzytelności	0	0	0,00	0	0	0,00
14. Weksle	0	0	0,00	0	0	0,00
15. Depozyty	0	0	0,00	0	0	0,00
16. Waluty	0	0	0,00	0	0	0,00
17. Nieruchomości	0	0	0,00	0	0	0,00
18. Statki morskie	0	0	0,00	0	0	0,00
19. Inne	0	0	0,00	0	0	0,00

TABELUZUPEŁNIAJĄCE

DŁUŻNE PAPIERY WARTOŚCIOWE	Rodzaj rynku	Nazwa rynku	Emitent	Kraj siedziby emitenta	Termin wykupu
1. O terminie wykupu do 1 roku:					
a) Obligacje					
b) Bony skarbowe					
c) Bony pieniężne					
d) Inne					

2. O terminie wykupu powyżej 1 roku:					
a) Obligacje					
b) Bony skarbowe					
c) Bony pieniężne					
d) Inne					

INSTRUMENTY POCHODNE	Rodzaj rynku	Nazwa rynku	Emitent (wystawca)	Kraj siedziby emitenta (wystawcy)	Instrument bazowy
I. Wystandaryzowane instrumenty pochodne:					
1. Kontrakt Futures indeks giełdowy SPX HWAU1	Aktywny rynek - rynek regulowany	CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE	CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE	Stany Zjednoczone	Instrument: S&P 500 INDEX
2. Kontrakt Futures indeks giełdowy SPX ESU1	Aktywny rynek - rynek regulowany	CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE	CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE	Stany Zjednoczone	Instrument: S&P 500 INDEX
II. Niewystandaryzowane instrumenty pochodne					
1. Kontrakt Forward Waluta PLN FWD USD/PLN	Nienotowane na rynku aktywnym	Nie dotyczy	MBANK S.A.	Polska	Waluta: USD

JEDNOSTKI UCZESTNICTWA I CERTYFIKATY INWESTYCYJNE	Rodzaj rynku	Nazwa rynku	Nazwa i rodzaj funduszu	Liczba	Wartość według ceny nabycia w tys.
I. Jednostki uczestnictwa				0,0000	0
II. Certyfikaty inwestycyjne				0	0

DEPOZYTY	Nazwa banku	Kraj siedziby banku	Waluta	Warunki oprocentowania	Wartość według ceny nabycia w danej walucie	Wartość według ceny nabycia w tys.
I. W walutach państw należących do OECD						0
II. W walutach państw nienależących do OECD						0

WALUTY	Państwo	Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość na dzień bilansowy w danej walucie	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
I. W walutach państw należących do OECD		0		0	0,00
II. W walutach państw nienależących do OECD		0		0	0,00

NIERUCHOMOŚCI	Rok oddania do użytku	Data nabycia	Numer księgi wieczystej	Kraj położenia	Adres	Powierzchnia
I. Prawa własności nieruchomości:						
1. Budynki						
2. Lokale						

		0	0	0	0,00
		0	0	0	0,00
		0	0	0	0,00
		0	0	0	0,00
		0	0	0	0,00

Liczba	Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
8	0	0	0,00
5	0	0	0,00
6	0	0	0,00
220 000	0	-5	-0,10
220 000	0	-5	-0,10

Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
0	0,00
0	0,00

Wartość według wyceny na dzień bilansowy w danej walucie	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
	0	0,00
	0	0,00

Obciążenia	Służebności	Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
		0	0	0,00
		0	0	0,00
		0	0	0,00

a)						
3. Grunty						
4. Inne						
II. Prawa współwłasności nieruchomości:						
1. Budynki						
2. Lokale						
3. Grunty						
4. Inne						
III. Użytkowanie wieczyste:						
1. Budynki						
2. Lokale						
3. Grunty						
4. Inne						

BILANS	2 kwartał		2 kwartał		rok	0 kwartał	
	2021	roku	2021	roku		roku	roku
I. Aktywa		5 338		4 951			0
1. Środki pieniężne i ich ekwiwalenty		5 305		4 920			0
2. Należności		32		29			0
3. Transakcje przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu		0		0			0
4. Składniki lokat notowane na aktywnym rynku, w tym:		0		0			0
- dłużne papiery wartościowe		0		0			0
5. Składniki lokat nienotowane na aktywnym rynku, w tym:		0		2			0
- dłużne papiery wartościowe		0		0			0
6. Nieruchomości		0		0			0
7. Pozostałe aktywa		0		0			0
II. Zobowiązania		70		64			0
III. Aktywa netto (I-II)		5 267		4 887			0
IV. Kapitał funduszu		4 820		4 820			0
1. Kapitał wpłacony		4 820		4 820			0
2. Kapitał wypłacony (wielkość ujemna)		0		0			0
V. Dochody zatrzymane		452		90			0
1. Zakumulowane, nierozdysponowane przychody z lokat netto		-31		-8			0
2. Zakumulowany, nierozdysponowany zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat		483		98			0
VI. Wzrost (spadek) wartości lokat w odniesieniu do ceny nabycia		-5		-23			0
VII. Kapitał funduszu i zakumulowany wynik z operacji (IV+V+/-VI)		5 267		4 887			0

Liczba zarejestrowanych certyfikatów inwestycyjnych	71 505	71 505		0
Wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny	73,66	68,35		0,00

Przewidywana liczba certyfikatów inwestycyjnych	71 505
Rozwodniona wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny	73,66

Liczba certyfikatów inwestycyjnych w podziale na serie certyfikatów:

A 71 505,000

		0	0	0,00
		0	0	0,00
		0	0	0,00
		0	0	0,00
		0	0	0,00
		0	0	0,00
		0	0	0,00
		0	0	0,00
		0	0	0,00
		0	0	0,00
		0	0	0,00
		0	0	0,00
		0	0	0,00
		0	0	0,00
		0	0	0,00
		0	0	0,00

Wartość aktywów netto na poszczególne serie certyfikatów inwestycyjnych:

Certyfikat inwestycyjny bez podziału na serie 73,66

		Narastająco kwartały roku bieżącego kwartał: rok: od: do:	Okres roku poprzedniego od: do:	Narastająco kwartały roku poprzedniego kwartał: rok: od: do:
RACHUNEK WYNIKU Z OPERACJI	od 2021-04-01	2		0
		2021		
	do 2021-06-30	2021-02-08		
		2021-06-30		
I. Przychody z lokat	0	25	0	0
1. Dywidendy i inne udziały w zyskach	0	0	0	0
2. Przychody odsetkowe	0	0	0	0
3. Przychody związane z posiadaniem nieruchomości	0	0	0	0
4. Dodatnie saldo różnic kursowych	0	25	0	0
5. Pozostałe	0	0	0	0
II. Koszty funduszu	88	133	0	0
1. Wynagrodzenie dla towarzystwa	7	13	0	0
2. Wynagrodzenia dla podmiotów prowadzących dystrybucję	0	0	0	0
3. Opłaty dla depozytariusza	16	26	0	0
4. Opłaty związane z prowadzeniem rejestru aktywów funduszu	6	8	0	0
5. Opłaty za zezwolenia oraz rejestracyjne	0	0	0	0
6. Usługi w zakresie rachunkowości	17	26	0	0
7. Usługi w zakresie zarządzania aktywami funduszu	0	0	0	0
8. Usługi prawne	1	1	0	0
9. Usługi wydawnicze, w tym poligraficzne	0	0	0	0
10. Koszty odsetkowe	0	0	0	0
11. Koszty związane z posiadaniem nieruchomości	0	0	0	0
12. Ujemne saldo różnic kursowych	1	0	0	0
13. Pozostałe	40	59	0	0
III. Koszty pokrywane przez towarzystwo	65	77	0	0
IV. Koszty funduszu netto (II-III)	23	56	0	0
V. Przychody z lokat netto (I-IV)	-23	-31	0	0
VI. Zrealizowany i niezrealizowany zysk (strata)	403	478	0	0
1. Zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat, w tym:	385	483	0	0
-z tytułu różnic kursowych	0	0	0	0
2. Wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat, w tym:	18	-5	0	0
-z tytułu różnic kursowych		0	0	0
VII. Wynik z operacji	380	447	0	0
Wynik z operacji przypadający na certyfikat inwestycyjny	5,31	6,25	0,00	0,00
Rozwodniony wynik z operacji przypadający na certyfikat inwestycyjny	5,31	6,25	0,00	0,00

		Narastająco kwartały roku bieżącego kwartał: rok: od: do:	Okres roku poprzedniego od: do:	Narastająco kwartały roku poprzedniego kwartał: rok: od: do:
ZESTAWIENIE ZMIAN W AKTYWACH NETTO	od 2021-04-01	2		0
		2021		
	do 2021-06-30	2021-02-08 2021-06-30		
1. Wartość aktywów netto na koniec poprzedniego okresu sprawozdawczego	4 887	0	0	0
2. Wynik z operacji za okres sprawozdawczy (razem), w tym:	380	447	0	0
a) przychody z lokat netto	-23	-31	0	0
b) zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	385	483	0	0
c) wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat	18	-5	0	0
3. Zmiana w aktywach netto z tytułu wyniku z operacji	380	447	0	0
4. Dystrybucja dochodów (przychodów) funduszu (razem)	0	0	0	0
a) z przychodów z lokat netto	0	0	0	0
b) ze zrealizowanego zysku ze zbycia lokat	0	0	0	0
c) z przychodów ze zbycia lokat	0	0	0	0
5. Zmiany w kapitale w okresie sprawozdawczym (razem), w tym:	0	4 820	0	0
a) zmiana kapitału wpłaconego (powiększenie kapitału z tytułu wydanych certyfikatów inwestycyjnych)	0	4 820	0	0
b) zmiana kapitału wypłaconego (zmniejszenie kapitału z tytułu wykupionych certyfikatów inwestycyjnych)	0	0	0	0
6. Łączna zmiana aktywów netto w okresie sprawozdawczym	380	5 267	0	0
7. Wartość aktywów netto na koniec okresu sprawozdawczego	5 267	5 267	0	0
8. Średnia wartość aktywów netto w okresie sprawozdawczym	5 129	5 033	0	0
a) liczba wydanych certyfikatów inwestycyjnych	0	71 505	0	0
b) liczba wykupionych certyfikatów inwestycyjnych	0	0	0	0
c) saldo zmian	0	71 505	0	0
d) liczba wydanych certyfikatów inwestycyjnych	71 505	71 505	0	0
e) liczba wykupionych certyfikatów inwestycyjnych	0	0	0	0
f) saldo zmian	71 505	71 505	0	0
9. Przewidywana liczba certyfikatów inwestycyjnych	71 505	71 505	0	0
10. wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny na koniec poprzedniego okresu sprawozdawczego	68,35	67,41	0,00	0,00
11. wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny na koniec bieżącego okresu sprawozdawczego	73,66	73,66	0,00	0,00
12. procentowa zmiana wartości aktywów netto na certyfikat inwestycyjny w okresie sprawozdawczym	30,82	23,67	0,00	0,00
13. minimalna wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny w okresie sprawozdawczym	69,07	66,87	0,00	0,00
- data wyceny	2021-04-01	2021-03-24		
14. maksymalna wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny w okresie sprawozdawczym	73,66	73,66	0,00	0,00
- data wyceny	2021-06-30	2021-06-30		
15. wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny według ostatniej wyceny w okresie sprawozdawczym	73,66	73,66	0,00	0,00
- data wyceny	2021-06-30	2021-06-30		
16. Rozwodniona wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny	73,66	73,66	0,00	0,00
I. Procentowy udział kosztów funduszu w średniej wartości aktywów netto, w tym:	6,88	6,74	0,00	0,00
1. procentowy udział wynagrodzenia dla towarzystwa	0,55	0,66	0,00	0,00
2. procentowy udział wynagrodzenia dla podmiotów prowadzących dystrybucję	0,00	0,00	0,00	0,00
3. procentowy udział opłat dla depozytariusza	1,25	1,32	0,00	0,00
4. procentowy udział opłat związanych z prowadzeniem rejestru aktywów funduszu	0,47	0,41	0,00	0,00
5. procentowy udział opłat za usługi w zakresie rachunkowości	1,33	1,32	0,00	0,00
6. procentowy udział opłat za usługi w zakresie zarządzania aktywami funduszu	0,00	0,00	0,00	0,00

Narastająco kwartaly roku bieżącego kwartał: rok: od: do:	Okres roku poprzedniego od: do:	Narastająco kwartaly roku poprzedniego kwartał: rok: od: do:
---	--	--

RACHUNEK PRZEPLÝWÓW PIENIĘŻNYCH	od 2021-04-01	2		0
		2 021		0
	do 2021-06-30	2021-02-08 2021-06-30		
A. Przepływy środków pieniężnych z działalności operacyjnej	385	485	0	0
I. Wpływy	5 617	6 680	0	0
1. Z tytułu posiadanych lokat	0	0	0	0
2. Z tytułu zbycia składników lokat	5 600	6 637	0	0
3. Pozostałe	17	43	0	0
II. Wydatki	5 232	6 195	0	0
1. Z tytułu posiadanych lokat	0	0	0	0
2. Z tytułu nabycia składników lokat	5 223	6 162	0	0
3. Z tytułu wypłaconego wynagrodzenia dla towarzystwa	0	3	0	0
4. Z tytułu wypłaconego wynagrodzenia dla podmiotów prowadzących dystrybucję	0	0	0	0
5. Z tytułu opłat dla depozytariusza	5	5	0	0
6. Z tytułu opłat związanych z prowadzeniem rejestru aktywów funduszu	2	2	0	0
7. Z tytułu opłat za zezwolenia oraz opłat rejestracyjnych	0	0	0	0
8. Z tytułu usług w zakresie rachunkowości	2	3	0	0
9. Z tytułu usług w zakresie zarządzania aktywami funduszu	0	0	0	0
10. Z tytułu usług prawnych	0	0	0	0
11. Z tytułu posiadania nieruchomości	0	0	0	0
12. Pozostałe	0	20	0	0
B. Przepływy środków pieniężnych z działalności finansowej	0	4 820	0	0
I. Wpływy	0	4 820	0	0
1. Z tytułu wydania certyfikatów inwestycyjnych	0	4 820	0	0
2. Z tytułu zaciągniętych kredytów	0	0	0	0
3. Z tytułu zaciągniętych pożyczek	0	0	0	0
4. Z tytułu spłaty udzielonych pożyczek	0	0	0	0
5. Odsetki	0	0	0	0
6. Pozostałe	0	0	0	0
II. Wydatki	0	0	0	0
1. Z tytułu wykupienia certyfikatów inwestycyjnych	0	0	0	0
2. Z tytułu spłat zaciągniętych kredytów	0	0	0	0
3. Z tytułu spłat zaciągniętych pożyczek	0	0	0	0
4. Z tytułu wyemitowanych obligacji	0	0	0	0
5. Z tytułu wypłaty przychodów	0	0	0	0
6. Z tytułu udzielonych pożyczek	0	0	0	0
7. Odsetki	0	0	0	0
8. Pozostałe	0	0	0	0
C. Skutki zmian kursów wymiany środków pieniężnych i ekwiwalentów środków pieniężnych	0	26	0	0
D. Zmiana stanu środków pieniężnych netto (A+/-B)	385	4 920	0	0
E. Środki pieniężne i ekwiwalenty środków pieniężnych na początek okresu sprawozdawczego	4 920	0	0	0
F. Środki pieniężne i ekwiwalenty środków pieniężnych na koniec okresu sprawozdawczego (E+/-D)	5 305	4 920	0	0

NOTY

NOTA-IPOLITYKARACHUNKOWOŚCI

Plik Nota_1.pdf	Opis Nota 1
--------------------	----------------

NOTA-ZNALEŻNOŚĆ FUNDUSZU	2 kwartał
	2021 roku
1. Z tytułu zbytych lokat	0
2. Z tytułu instrumentów pochodnych	0
3. Z tytułu wydanych certyfikatów inwestycyjnych	0
4. Z tytułu dywidendy	0
5. Z tytułu odsetek	0
6. Z tytułu posiadanych nieruchomości, w tym czynszów	0
7. Z tytułu udzielonych pożyczek	0
8. Pozostałe	32
a) Z tytułu rozliczeń międzyokresowych kosztów	10
b) Z tytułu pokrywania kosztów przez Towarzystwo	22

NOTA-ZOBOWIĄZANIA FUNDUSZU	2 kwartał
	2021 roku
1. Z tytułu nabytych aktywów	0
2. Z tytułu transakcji przy zobowiązaniu się funduszu do odkupu	0
3. Z tytułu instrumentów pochodnych	5
4. Z tytułu wpłat na certyfikaty inwestycyjne	0
5. Z tytułu wykupionych certyfikatów inwestycyjnych	0
6. Z tytułu wypłaty dochodów funduszu	0
7. Z tytułu wypłaty przychodów funduszu	0
8. Z tytułu wyemitowanych obligacji	0
9. Z tytułu krótkoterminowych pożyczek i kredytów	0
10. Z tytułu długoterminowych pożyczek i kredytów	0
11. Z tytułu gwarancji lub poręczeń	0
12. Z tytułu rezerw	65
13. Pozostałe zobowiązania	0

INFORMACJA DODATKOWA

Plik	Opis
Informacja_dodatkowa.pdf	Informacja dodatkowa

PODPISY

PODPISY OSÓB REPREZENTUJĄCYCH FUNDUSZ			
Data	Imię i Nazwisko	Stanowisko/Funkcja	Podpis
2021-08-04	Mariusz Jagodziński	Prezes Zarządu	
2021-08-04	Wojciech Somerski	Wiceprezes Zarządu	
2021-08-04	Marcin Grabowski	Członek Zarządu	

2021-08-04	Marta Brzostowska	Pełnomocnik Vistra Fund Services Poland Sp. z o.o. S.K.A., Zastępca Dyrektora Departamentu Funduszy i Portfeli VISTRA Fund Services Poland Sp. z o. o. Podmiotu, któremu powierzono prowadzenie ksiąg rachunkowych	
------------	-------------------	--	--

Potwierdzenie wysłania raportu do Komisji Nadzoru Finansowego

RAPORT ODEBRANY: Raport FIZ-Q-E_30.04.18 przekazano do kancelarii Publiczna GPW.

Data odebrania: 2021-08-04 12:23

Konto: ESFB500BOB.

Funkcja skrótu dla paczki raportu (SHA) 55bea26013bdeb8f885aa2e84f4ba1f106705bf823e835b369af6508a22