

Warszawa, 27 sierpnia 2024 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 1 stycznia 2024 r. do 30 czerwca 2024 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 260,57 zł według wyceny bilansowej, co oznaczało spadek o 18,44 zł, czyli o -6,61% w stosunku do wartości aktywów netto na Certyfikat na dzień 31 grudnia 2023 r., tj. na koniec poprzedniego roku obrotowego, wynoszącej 279,01 zł. W rozpatrywanym okresie kurs Certyfikatów pozostawał w trendzie spadkowym zapoczątkowanym jesienią 2022 roku. Wynikało to z utrzymywania się w tym okresie z trendu wzrostowego na rynku polskich akcji, co w związku z odwróconą konstrukcją Funduszu spowodowało spadki wartości jego Certyfikatów. W całym okresie sprawozdawczym maksymalna wartość aktywów netto na Certyfikat wynosiła 302,85 zł i miała miejsce w dniu 17 stycznia 2024 r., natomiast minimalna wartość aktywów netto na Certyfikat wyniosła 255,99 zł i miała miejsce w dniu 20 maja 2024 r. Wartość aktywów netto na dzień 30 czerwca 2024 r. wynosiła 47 298 tys. zł, co odpowiadało 181 517 Certyfikatom. W porównaniu do analogicznych wartości na koniec poprzedniego roku obrotowego wynoszących odpowiednio 35 718 tys. zł i 128 017 Certyfikatów, aktywa netto wzrosły w okresie sprawozdawczym o 32,42%, natomiast liczba Certyfikatów zwiększyła się o 41,79%. W okresie tym wyemitowano łącznie 105 500 Certyfikatów o wartości 28 518 tys. zł oraz dokonano wykupu 52 000 Certyfikatów o wartości 14 597 tys. zł.

W całym okresie sprawozdawczym nie wystąpiły przypadki wystąpienia trudności w realizacji strategii inwestycyjnej określonej w statucie. Stopa zwrotu certyfikatu inwestycyjnego w okresie sprawozdawczym wyniosła wspomniane -6,61% przy stopie zwrotu indeksu równej -4,83%, co odpowiadało wartości różnicy odwzorowania (Tracking Difference) na poziomie -1,78%.

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.

Jacek Dekarz  
Prezes Zarządu

Mariusz Skwaroń  
Wiceprezes Zarządu

Marek Arent  
Członek Zarządu

/podpisano kwalifikowanym  
podpisem elektronicznym/

/podpisano kwalifikowanym  
podpisem elektronicznym/

/podpisano kwalifikowanym  
podpisem elektronicznym/