

BETA ETF WIG20short

XXVI Konferencja Wall Street

WIG20short

WIG20short jest indeksem pochodnym do indeksu WIG20, ponieważ jego wartości zależą od wartości indeksu WIG20. Indeks WIG20short stanowi odwrotność w stosunku do indeksu WIG20: podąża w przeciwnym kierunku niż WIG20, tj. wzrost WIG20 o 1 proc. powoduje spadek WIG20short o 1 proc. i odwrotnie. Zależność ta jest prawdziwa wyłącznie dla horyzontu jednosesyjnego. W dłuższych okresach czasu dźwignia może znacząco odbiegać od intuicyjnej wynoszącej -1.

Cel inwestycyjny

Celem inwestycyjnym funduszu BETA ETF WIG20short Portfelowy FIZ jest osiągnięcie stóp zwrotu, których wielkość odzwierciedla procentowe zmiany wartości indeksu WIG20short dla takich samych okresów.

Typ funduszu	ETF – portfelowy FIZ
ISIN	PLBETF200011
Benchmark	WIG20Short
Pierwszy dzień notowań	27.11.2019
Ticker GPW	ETFBW20ST
Firma zarządzająca	AgioFunds TFI SA
Bank-depozytariusz	mBank SA
Koordinator / Animator	DM BOŚ SA
Wartość aktywów netto*	20,2 mln zł
Wartość certyfikatu*	357,43
Opłata za zarządzanie	1,00%
Całkowity wskaźnik kosztów	~3,00%
Poziom ryzyka	6/7 (wysoki)
Rekomendowany horyzont	1 dzień
Metoda replikacji	Syntetyczna (futures)

Skumulowana stopa zwrotu WIG20short

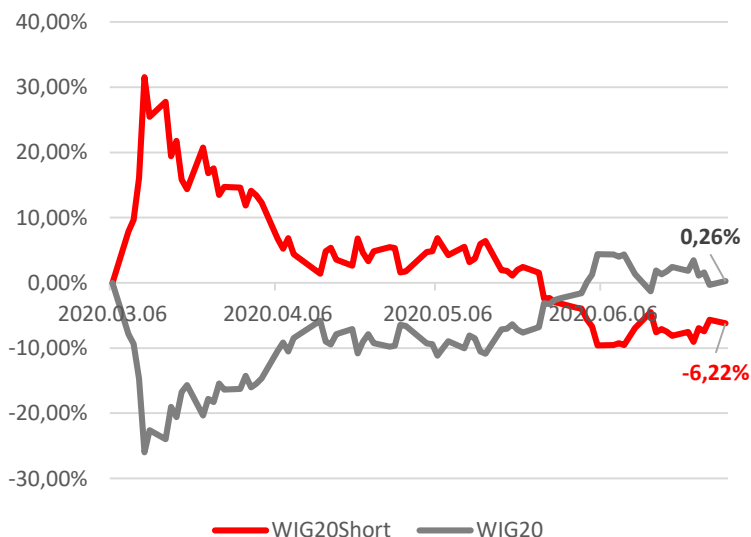


Specyfika WIG20short i BETA ETF WIG20short

Fundusze ETF odwrócone nie są produktami odpowiednimi do długoterminowego inwestowania. Są to produkty do realizacji strategii spekulacyjnych lub ewentualnie strategii zabezpieczających.

Rzeczywista stopa zwrotu może znacząco odbiegać od intuicyjnej stopy zwrotu.

Opłata za zarządzanie jest istotnie wyższa niż w przypadku tradycyjnych ETF. Jednakże z uwagi na krótki horyzont inwestycyjny nie jest to istotny element tego funduszu. Istotniejszymi jest szerokość spread, popularność ETF wśród pozostałych inwestorów oraz aktywność obrotu.



Efektywność odwzorowania indeksu

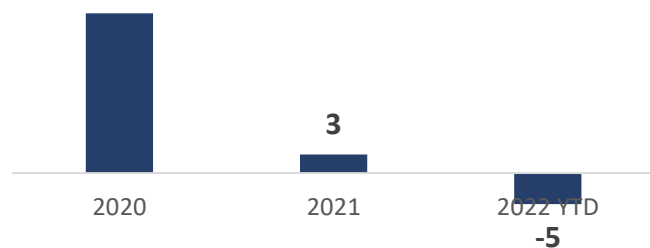


	YTD	2021	1 rok	2 lata
WIG20short	21,85%	-14,81%	13,00%	-17,01%
ETFBW20ST	20,05%	-18,53%	7,02%	-22,53%
Różnica odwzorowania	-1,81%	-3,72%	-5,98%	-5,52%

Zalety inwestycji w Fundusz:

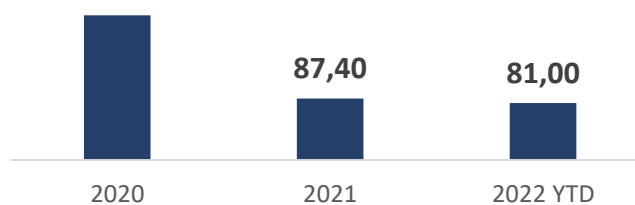
- ✓ 1 certyfikat to ekspozycja na indeks WIG20short,
- ✓ Indeksowa strategia inwestycyjna,
- ✓ odwrócona dźwignia finansowa,
- ✓ dostępność już od kilkuset złotych,
- ✓ efektywna podatkowo inwestycja,
- ✓ łączne rozliczenie z pozostałymi inwestycjami giełdowymi,

25,7



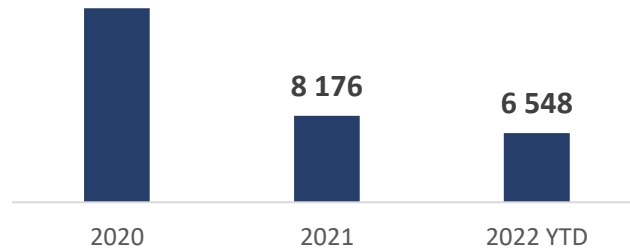
■ Napływ/odpływ z rynku GPW

205,40



■ Wartość obrotów (mln PLN)

18 372



■ Liczba transakcji

Dobre praktyki inwestowania w ETF

- ✓ *Transakcji dokonuj na rynku giełdowym,*
- ✓ *Wybieraj zlecenia z LIMITEM,*
- ✓ *Składaj zlecenia na sesję – wolumeny na zamknięciu zazwyczaj nie są duże,*
- ✓ *Ograniczaj koszt prowizji maklerskich (minimalna wielkość prowizji, promocje),*
- ✓ *Korzystaj z efektywnych kont emerytalnych IKE bądź IKZE,*

Więcej na stronie:

betasecurities.pl/kompedium

Źródło: Obliczenia własne na podstawie agiofunds.pl, gpw.pl

Przedstawione informacje finansowe mają charakter historyczny i nie stanowią gwarancji osiągnięcia podobnych stóp zwrotu w przyszłości. Inwestowanie w certyfikaty inwestycyjne Funduszu wiąże się z ryzykiem, a Fundusz nie gwarantuje osiągnięcia przyjętego celu inwestycyjnego. Uczestnicy Funduszu muszą się liczyć z ryzykiem utraty części lub całości wpłaconych środków. Indywidualna stopa zwrotu z inwestycji w certyfikaty inwestycyjne uzależniona jest od wartości certyfikatów inwestycyjnych w momencie ich nabycia i zbycia oraz opłat prowizji brokerskich i należnego podatku od dochodów kapitałowych. Wartość aktywów netto Funduszu cechuje się dużą zmiennością ze względu na skład portfela inwestycyjnego. Szczegółowe informacje dotyczące Funduszu, w tym opis ryzyka inwestycyjnego, informacje o opłatach oraz kosztach działalności Funduszu znajdują się w Prospekcie Emisyjnym dostępnym na stronie internetowej www.agiofunds.pl oraz www.bossa.pl. Informacje zawarte w materiale mają charakter promocyjny i nie należy ich traktować jako rekomendacji dotyczącej inwestycji w określone instrumenty finansowe. Dochody z inwestycji w fundusze inwestycyjne dokonywane przez osoby fizyczne podlegają opodatkowaniu podatkiem od dochodów kapitałowych. Niniejsza informacja nie stanowi usługi doradztwa inwestycyjnego i nie jest ofertą w rozumieniu art. 66 Kodeksu Cywilnego. Organem nadzorującym AgioFunds TFI SA jest Komisja Nadzoru Finansowego. Oferta publiczna certyfikatów inwestycyjnych Funduszu ma miejsce wyłącznie na terenie Rzeczypospolitej Polskiej. Niniejszy materiał nie zawiera ani nie stanowi oferty nabycia certyfikatów inwestycyjnych Funduszu, ani też zaproszenia do złożenia oferty nabycia certyfikatów inwestycyjnych w Stanach Zjednoczonych Ameryki, Kanadzie lub Japonii, ani w jakiegokolwiek innej jurysdykcji, w której taka oferta lub zaproszenie byłoby sprzeczne z prawem. Nie będzie prowadzona żadna oferta publiczna certyfikatów inwestycyjnych w Stanach Zjednoczonych Ameryki. Niniejszy materiał nie może być rozpowszechniany w Stanach Zjednoczonych Ameryki, Australii, Kanadzie i Japonii. Prawa autorskie wynikające z niniejszego materiału przysługują AgioFunds TFI SA.