

СПРАВКА С ДОПЪЛНИТЕЛНА ИНФОРМАЦИЯ

за

Договорен фонд "Експат Глобални Облигации"
съгласно изискванията на чл. 75, т. 2, от Наредба 44
за първо шестмесечие на 2019 г.

I. Информация съгласно чл. 73, ал. 1, т. 5, букви "а"- "д" във връзка с чл. 75, т. 2 от Наредба 44

1. Обща информация

Договорен фонд „Експат Глобални Облигации“, организиран и управляван от Управляващо дружество „Експат Асет Мениджмънт“ ЕАД, е колективна инвестиционна схема от отворен тип за инвестиране в държавни ценни книжа, ипотечни, общински и корпоративни облигации и други ликвидни финансови активи, учреден и осъществяващ своята дейност в съответствие със Закона за дейността на колективните инвестиционни схеми и на други предприятия за колективно инвестиране (ЗДКИСДПКИ), Закона за задълженията и договорите и останалото приложимо законодателство на Република България.

Основната цел на Договорния фонд е запазване на стойността на неговите активи, както и нарастване на стойността на инвестициите на притежателите на дялове, доколкото е съвместимо, чрез реализиране на оптимален възможен доход при поемане на ниско ниво на риск и осигуряване на максимална ликвидност на инвестициите на притежателите на дялове. Фондът е регистриран в Регистър Булстат към Агенцията по вписванията с Булстат код номер 175801906.

2. Информация по чл. 73, ал.1, т.5, б. "а", "б": Брой дялове в обръщение и нетна стойност на активите на един дял за отчетния период

Към 1 януари 2019 г. дяловете в обръщение са 5,524.38 броя, към 30 юни 2019 г. 4, 845.2975 броя.

През периода са предявени 774.6785 дяла за обратно изкупуване на Фонда, а са емитирани 95.5961 дяла.

Нетната стойност на активите на един дял на 30 юни 2019 г. е 1,562.0155 лв.

3. Информация по чл. 73, ал.1, т.5, б. "в": Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

Вид финансови инструменти	Стойност към 30.06.2019 г. (BGN)	% от стойността на активите	Стойност към 31.12.2019 г. (BGN)	% от стойността на активите
Акции	549 980	7.25%	413 309	5.07%
Дългови ценни книжа вкл. лихви	6 417 989	84.55%	6 961 964	85.44%
Дялове на колективни инвестиционни схеми	447 469	5.89%	653 182	8.02%
Други финансови инструменти	0	0.0%	0	0.0%
Парични средства в разплащателни сметки	150 893	1.99%	116 233	1.43%
Вземания, в т.ч. вземания от лихви, дивиденди	24 423	0.32%	3 855	0.05%
	7 590 754	100.0%	8 148 543	100.0%

4. Информация по чл. 73, ал.1, т.5, т. "г": Промени в структурата на портфейла за отчетния период

За отчетния период УД Експат Асет Мениджмънт извърши следните промени по структурата на портфейла на ДФ "Експат Глобални Облигации". Теглото на акциите в портфейла бе увеличено от 5.07% до 7.25%, а теглото на инструментите с фиксирана доходност намалено от 85.44% до 84.55% от активите на фонда. Теглото на КИС и други инвестиционни дружества бе намалено от 8.02% до 5.89%, а това на паричните средства увеличено от 1.43% до 1.99% от активите на фонда.

Разпределението на активите на Фонда по страни и класове облигации бе променено, както следва: Делът на държавни ценни книжа с експозиция към развити страни бе увеличен от 16.99% на 20.00%, делът на корпоративни облигации с инвестиционен кредитен рейтинг от развити страни бе намален от 7.02% на 3.10%, а високодоходните облигации в същия регион бяха намалени от 11.33% на 0.81%. Облигациите с експозиция към развиващите се страни претърпяха следната промяна: Делът на държавните ценни книжа бе увеличен от 15.79% на 22.16%, а корпоративния сектор претърпя увеличение от 34.31% на 38.49%.

В края на юни 2019 г. дюрацията на портфейла на ДФ „Експат Бондс“ по-ниска спрямо края на 2018 г. от 4 до 2.19.

Вид финансови инструменти	Стойност към 30.06.19 г.	% от стойността на активите	Стойност към 31.12.18 г.	% от стойността на активите
Акции	549 980	7.25%	413 309	5.07%
Държавни ценни книжа	3 200 276	42.16%	2 670 760	32.78%
Корпоративни облигации	3 217 713	42.39%	4 291 204	52.66%
КИС и други инвестиционни дружества	447 469	5.89%	653 182	8.02%
Деривативни инструменти	0	0.0%	0	0.0%
Парични средства	150 893	1.99%	116 233	1.43%
Вземания	24 423	0.32%	3 855	0.05%
	7 590 754	100.0%	8 148 543	100.0%

5. Информация по чл. 73, ал.1, т.5, б. "д": Информация за промените в състоянието на активите в рамките на отчетния период

Приходи	01.01.2019-30.06.2019 (BGN)	01.01.2019-30.06.2019 (BGN)
Приходи от дивиденди	3 382	17 984
Приходи от лихви	155 908	143 069
Приходи от валутни операции	1 651 974	0
	1 811 264	161 053

Приходи / (разходи) от операции с инвестиции	01.01.2019-30.06.2019 (BGN)	01.01.2019-30.06.2019 (BGN)
Положителни разлики от операции с финансови активи	149 877	426 566
Отрицателни разлики от операции с финансови активи	(120 476)	(531 454)
Нетна положителна/(отрицателна) разлика от последваща оценка на финансови активи	394 969	(216 841)
	424 370	(321 729)

Разходи	01.01.2019-30.06.2019 (BGN)	01.01.2018-30.06.2018 (BGN)
Финансови разходи	86 359	57 494
Разход за външни услуги	442	2 412
Разходи от валутни операции	1 675 547	0
	1 762 348	59 906

	01.01.2019-30.06.2019 (BGN)	01.01.2018-30.06.2018 (BGN)
Такси и комисиони към управляващото дружество	82 800	49 815
Такси и комисиони към банката - депозитар	3 167	3 967
Такси към инвестиционни посредници	104	366

	01.01.2019-30.06.2019 (BGN)	01.01.2018-30.06.2018 (BGN)
Общо приходи	2 356 110	587 619
Общо разходи	(1 882 824)	(808 201)
Нетен резултат	473 286	(220 582)

Текущи задължения	Към 30.06.2019 (BGN)
Задължения към УД по договор за управление	10 511
Задължения към банка депозитар	183
Задължения, свързани с обратно изкупуване	10 053
Задължения, свързани със сделки с финансови инструменти	0
Други	6
Общо:	20 753

Текущи вземания	Към 30.06.2019 (BGN)
Вземания по сделки с финансови инструменти	24 423
Вземания от лихви, дивиденди	0
	24 423

Никола Янков:
(Председател на СД)

Никола Веселинов:
(Член на СД)

