

Информация

Съгласно насоки на CESR за измерване на риска и изчисляване на обща рискова експозиция и риска на насрещната страна при колективните инвестиционни схеми (10-788)

УД „Експат Асет Мениджмънт“ ЕАД не използва метода „стойност под риск“ (VaR) при изчисляването на общата рискова експозиция на управляваните от него колективни инвестиционни схеми. УД „Експат Асет Мениджмънт“ ЕАД управлява единадесет борсово търгувани фонда, три взаимни фонда, инвестиращи основно в акции, два взаимни фонда, инвестиращи основно в облигации, един национален борсово търгуван фонд, инвестиращ в акции, и един национален борсово търгуван фонд, инвестиращ предимно в борсово търгувани фондове върху злато. По-долу Ви представяме методите за управление на риска и изчисляването на общата рискова експозиция на ДФ Експат Акции Развиващи се Пазари.

При управлението на ДФ Експат Акции Развиващи се Пазари Управляващото дружество използва строго определени лимити, описани в Правилата и Проспекта на фонда. Фондът е активно управляван и инвестира в акции от развиващите се страни. За да се осигури адекватно ниво на управление на риска, Управляващото дружество използва разпределението по страни и сектори на широкия индекс MSCI Emerging Markets, като се стреми общата експозиция към дадена страна и/или сектор да отговаря на бета коефициента на тази страна и/или сектор от индекса MSCI Emerging Markets. Отдел „Управление на портфейли“ инвестира в отделните страни от минимум 0% до определените в Проспекта максимални нива на експозиция. При управлението на експозицията към даден сектор отдел „Управление на портфейли“ инвестира до максимум 30% в единичен сектор с цел по-висока диверсификация. При надвишаване на този лимит отдел „Управление на риска“ уведомява Съвета на директорите на Управляващото дружество, който взима решение дали експозицията да бъде запазена или да се намали, ако има икономически и пазарни фактори обуславящи намаляването на риска. Отдел „Управление на риска“ измерва общия риск на портфейла чрез стандартното отклонение на историческите цени на дяловете на седмична база.

Управляващото дружество извършва хеджиращи операции, имащи за цел да намалят валутния риск, предвид факта, че фондът инвестира основно в инструменти, деноминирани в твърда валута, но даващи експозиция към валути от развиващите се страни.

Лихвеният риск се управлява чрез ежедневното изчисление на модифицираната дюрация за облигациите в портфейла на фонда.

Дата: 04.03.2026 г.

Николай Василев
Изпълнителен директор

Даниел Дончев
Изпълнителен директор