

Информация

Съгласно насоки на CCSR 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 Амарант.

При управлението на ДФ Експат Амарант Управляващото дружество използва строго определени лимити, описани в Правилата и Проспекта на фонда. Фондът е активно управляван и инвестира в глобални акции. За да се осигури адекватно ниво на управление на риска, Управляващото дружество използва разпределението по страни и сектори на широкия индекс MSCI World, 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 World. 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 взема 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, като взема предвид пазарната конюнктура, волатилността (изчислена през стандартното отклонение) на дадената валута и разходите за хеджиране към евро (суапови точки за едномесечни форуърдни контракти).

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

Дата: 31.03.2026 г.

Николай Василев
Изпълнителен директор

Даниел Дончев
Изпълнителен директор