

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 Природни ресурси.

ДФ Експат Природни Ресурси инвестира предоминантно в акции в сектора на суровините, в това число в борсово търгувани фондове върху суровини и фючърси за суровини, благородни и цветни метали, акции на енергийни и добивни компании, публично предлагани на световните борси за търговия с финансови инструменти. Фондът се стреми да даде на дялопритежателите си експозиция върху енергийния и суровинен сектор, като поддържа диверсифициран портфейл от 50+ емитента. Управляващото дружество прилага следните стратегии за управление на риска:

Диверсификация: Фондът поддържа диверсифициран портфейл от инструменти с експозиция в различни географски райони, за да намали въздействието на всяко отделно събитие или пазарно движение. Това включва инвестиране в редица енергийни и минни компании, борсово търгувани фондове върху суровини и други финансови инструменти, а не концентриране на портфейла в няколко емитента, като по този начин специфичният риск на отделните емитенти е лимитиран.

Активно управление на портфейла: Фондът следва стратегия за активно управление на портфейла, за да наблюдава и коригира портфейла в отговор на промените в пазарните условия и резултатите на отделните емитенти. Това включва редовен преглед на портфейла, за да се идентифицират всички активи и подсектори, които не постигат достатъчно добри резултати, и съответно ребалансиране на портфейла.

Оценка на риска: Фондът редовно оценява риска на отделните емитенти и на портфейла като цяло, като използва количествени и качествени мерки. Това включва анализ на профила на риска и възвръщаемостта на всяка инвестиция и стрес-тест на портфейла спрямо редица сценарии, като например промени в цените на суровините, лихвените проценти и геополитическите рискове.

Хеджиране: Фондът може да използва стратегии за хеджиране, като например опции и фючърси, за да намали риска от неблагоприятни пазарни ивалутни движения.

Цялостната стратегия за управление на риска на ДФ Експат Природни ресурси има за цел да балансира риска и възвръщаемостта чрез диверсифициране на портфейла, активно управление на инвестициите, оценка на риска и хеджиране срещу неблагоприятни пазарни движения.

Дата 04.03.2026 г.

Николай Василев
Изпълнителен директор

Даниел Дончев
Изпълнителен директор