

Информация по чл. 82е на Наредба № 44

Национален договорен фонд

Експат България Шорт Софикс

за шестмесечния период, завършващ на 30 юни 2021

Информация за грешката от следване съобразно чл. 82е на Наредба № 44 от 20 октомври 2011 г. за изискванията към дейността на колективните инвестиционни схеми, управляващите дружества, националните инвестиционни фондове и лицата, управляващи алтернативни инвестиционни фондове

ISIN	Име на борсово търгуван фонд	Очаквана грешка от следване за 2021 г.	Реализирана грешка от следване към 30.06.2021 г.
BG9000002196	НДФ Експат България Шорт Софикс	до 10%	3.51%*

ISIN	Име на борсово търгуван фонд	Доходност на БТФ за първата половина на 2021 г.	Доходност на индекс за първата половина на 2021 г. с включени дивиденди	Разлика при следене за първата половина на 2021 г.
BG9000002196	НДФ Експат България Шорт Софикс	(17.23)%	(25.75)%	8.52%

* Реализираната грешка от следване е изчислена въз основа на седмични стойности за 52 седмици, предхождащи 30.06.2021 г.

За 2021 г. очакваме грешката от следване да не надхвърля 10% с оглед на ограничената история на търговия с борсово търгувани фондове на българския пазар, съответно и на борсово търгуван фонд Експат България Шорт СОФИКС .

Грешката от следване е волатилността (измерена чрез ануализираното стандартно отклонение) на разликата в доходността на Фонда и тази на Референтния индекс за определен период от време. По-ниска грешка от следване означава по-близко следване на Индекса. Това не е същото като разлика при следенето, която е просто разликата между доходността на Фонда и тази на Референтния индекс за определен период от време. Разликата при следенето показва с колко процента Фондът се е представил по-добре или по-зле от Индекса, докато грешката от следене показва постоянството в разликата в представянето на Фонда и Референтния индекс.

Дата: 30.07.2021

Николай Василев

Изпълнителен директор

Даниел Дончев

Изпълнителен директор