

Информация по чл. 82е на Наредба № 44

Експат Гърция АСЕ ЮСИТС БТФ

за шестмесечния период, завършващ на 30 юни 2023

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 2023 г. | Реализирана грешка от следване към 30.06.2023 г. |
|--------------|------------------------------|--|--|
| BGGRASE06174 | Expat Greece ASE UCITS ETF | до 10% | 2.52%* |

| ISIN | Име на борсово търгуван фонд | Доходност на БТФ за първата половина на 2023 г. | Доходност на индекс за първата половина на 2023 г. с включени дивиденди | Разлика при следене за първата половина на 2023 |
|--------------|------------------------------|---|---|---|
| BGGRASE06174 | Expat Greece ASE UCITS ETF | 37.43% | 39.93% | (2.5)% |

* Реализираната грешка от следване е изчислена въз основа на седмични стойности за 52 седмици, предхождащи 30.06.2023 г.

За 2023 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 Гърция АСЕ ЮСИТС БТФ .

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-близо 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: 24.07.2023 г.

Николай Василев
Изпълнителен директор

Даниел Дончев
Изпълнителен директор