

Информация по чл. 82е на Наредба № 44
Експат България СОФИКС ЮСИТС БТФ
за шестмесечния период, завършващ на 30 юни 2024

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 2024 г.	Реализирана грешка от следване към 30.06.2024 г.
BG9000011163	Expat Bulgaria SOFIX UCITS ETF	до 10%	3.06%*

ISIN	Име на борсово търгуван фонд	Доходност на БТФ за първата половина на 2024 г.	Доходност на индекс за първата половина на 2024 г. с включени дивиденди	Разлика при следене за първата половина на 2024 г.
BG9000011163	Expat Bulgaria SOFIX UCITS ETF	9.85%	12.17%	(2.32)%

* Реализираната грешка от следване е изчислена въз основа на седмични стойности за 52 седмици, предхождащи 30.06.2024 г.

За 2024 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 СОФИКС 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-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.

Николай Василев
Изпълнителен директор

Даниел Дончев
Изпълнителен директор