

Информация от НДФ “Конкорд Фонд – 7 Саут-Ийст Юръп” на основание чл. 236, ал. 1, т. 2, букви “а-в” от ЗДКИСДПКИ във връзка с чл. 237, ал. 3, т. 1

1. Дял на активите на НДФ, които са обект на специално третиране поради ниската им ликвидност

Към 31.03.2022 г. НДФ не е инвестирал в активи, които са обект на специално третиране поради ниската им ликвидност.

В портфейла на фонда извънборсовите ценни книжа към 31.03.2022 г. имат дял от 46,83% от активите, но те не попадат в дефиницията по чл. 234 от ЗДКИСДПКИ.

2. Прилагани нови подходи за управление на ликвидността на НДФ

През периода 01.01.2022 г. – 31.03.2022 г. не са използвани нови подходи за управление на ликвидността на АИФ при управлението на НДФ „Конкорд Фонд - 7 Саут-Ийст Юръп”. Подходите за управление на ликвидността на АИФ при управлението на „Конкорд Фонд - 7 Саут-Ийст Юръп” са описани в Прилаганите системи за управление на пазарния риск, ликвидния риск, риска от контрагента и на други рискове, включително оперативния риск на НДФ за съответния период, както и в Правила за оценка и управление на риска на НДФ.

3. Текущ рисков профил на НДФ

Според Насоки на CESR относно методологията за изчисляване на синтетични индикатор за риск и доходност /СИРД/ на даден фонд трябва да бъде променен, ако волатилността е излязла извън интервала, отговарящ на предишната му категория риск във всяка седмична референтна точка за данни през предшестващите 4 месеца. В този случай трябва да се предпише новата категория риск, отговаряща на интервала определен в Насоката, на който съответната волатилност е отговаряла през предишните 4 месеца.

Синтетичният индикатор за риск и доходност се променя ако съответната волатилност на Фонда е излязла извън обхвата, отговарящ на предишната му категория риск за всяка една седмична референтна точка за данни през предшестващите 4 месеца. Това означава, че ако волатилността на Фонда се е движила така, че да отговаря на повече от един интервал през 4-месечния период, на Фонда се приписва нов клас риск, съответстващ на интервала, на който е отговаряла съответната му волатилност за мнозинството от седмични референтни точки за данни по време на предшестващите 4 месеца.

Към края на месец март 2022 г. общо за предшестващите 4 месеца Фондът попада в следната категория риск: класът риск, съответстващ на интервала, на който отговаря съответната му волатилност за мнозинството седмични референтни точки за данни по време на предшестващите 4 месеца е "клас риск 4" (18 референтни точки за "клас риск 4" през последните 4 месеца).

Синтетичният индикатор за риск и доходност се базира на волатилността на възвръщаемостта (резултати от минали периоди) на фонда. За целта се използва седмична възвръщаемост на фонда от минали години на фонда. СИРД определя волатилността на възвръщаемостта като обща индикация относно общото ниво на риска на Фонда, отразяваща ефекта на всички съществени рискове, описани в Правилата. Доколкото рискови експозиции причиняват флукуации в нетната стойност на активите на Фонда, волатилността на неговата възвръщаемост отразява натоварванията във всички задвижващи механизми за риск и доходност, от които фондът генерира възвръщаемост.

Седмична справка (БАУД), на база 260 периода, наблюдение от 5 години

Дата на определяне	НСА на един дял	Ръст спрямо предходен период	Пълзяща средна за 260 периода	Вариация	Стандартно отклонение на дял за 260 периода	99% VAR 4 седмици	Стандартно отклонение на дял за 260 периода, 5г. год.база*	Синтетичен индикатор, Рисков профил
24.03.2022	12.3724	-0.035%	0.056%	0.010%	0.986%	4.588%	7.111%	клас риск 4
17.03.2022	12.3767	0.155%	0.055%	0.010%	0.986%	4.588%	7.113%	клас риск 4
10.03.2022	12.3575	-0.274%	0.054%	0.010%	0.986%	4.588%	7.113%	клас риск 4
24.02.2022	12.3914	-0.227%	0.062%	0.010%	0.991%	4.611%	7.148%	клас риск 4
17.02.2022	12.4196	-0.149%	0.056%	0.010%	0.997%	4.639%	7.191%	клас риск 4
10.02.2022	12.4381	-0.152%	0.066%	0.010%	1.009%	4.692%	7.273%	клас риск 4
03.02.2022	12.4570	0.020%	0.059%	0.010%	1.016%	4.729%	7.330%	клас риск 4
27.01.2022	12.4545	0.067%	0.058%	0.010%	1.017%	4.730%	7.332%	клас риск 4
20.01.2022	12.4462	0.085%	0.056%	0.010%	1.017%	4.732%	7.335%	клас риск 4
13.01.2022	12.4356	0.257%	0.058%	0.010%	1.018%	4.735%	7.340%	клас риск 4
06.01.2022	12.4037	-0.188%	0.058%	0.010%	1.018%	4.735%	7.340%	клас риск 4
30.12.2021	12.4271	0.073%	0.061%	0.010%	1.018%	4.736%	7.342%	клас риск 4
23.12.2021	12.4180	1.193%	0.061%	0.010%	1.018%	4.736%	7.342%	клас риск 4
16.12.2021	12.2716	-0.006%	0.059%	0.010%	1.017%	4.730%	7.331%	клас риск 4
09.12.2021	12.2723	-0.001%	0.063%	0.010%	1.019%	4.738%	7.345%	клас риск 4
02.12.2021	12.2724	-0.037%	0.066%	0.010%	1.019%	4.743%	7.352%	клас риск 4

4. Прилагани системи за управление на пазарния риск, ликвидния риск, риска от контрагента и на други рискове, включително оперативния риск

Прилаганите системи за управление на пазарния риск, ликвидния риск, риска от контрагента и на други рискове, включително оперативния риск на НДФ са описани в отделен документ, приложен към настоящата информация.
