

Информация от „Конкорд Фонд – 9 Грийн” АД 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 АИФ, които са обект на специално третиране поради ниската им ликвидност

Към 30.06.2026 г. АИФ не е инвестирал в активи, които са обект на специално третиране поради ниската им ликвидност.

Към 30.06.2026 г. в портфейла на фонда няма извънборсови ценни книжа.

2. Прилагани нови подходи за управление на ликвидността на АИФ

През периода 01.01.2026 г. – 30.06.2026 г. не са използвани нови подходи за управление на ликвидността на АИФ при управлението на „Конкорд Фонд – 9 Грийн” АД. Подходите за управление на ликвидността на АИФ при управлението на „Конкорд Фонд – 9 Грийн” АД са описани в Прилаганите системи за управление на пазарния риск, ликвидния риск, риска от контрагента и на други рискове, включително оперативния риск на АИФ за съответния период, както и в Правила за оценка и управление на риска на АИФ.

3. Текущ рисков профил на АИФ

Рисковият профил на АИФ се определя на база рискови категории като стойността на рисковата категория на Фонда съответства на степента на волатилност в цената на акциите на фонда за определен исторически период, като по-високата рискова категория означава по-голям потенциален риск за инвеститора. Степента на волатилност в цената на акциите на фонда е и мярка за пазарен риск. Преминаването на всеки праг се документира от звеното за управление на риска и се докладва за предприемане на коригиращи действия в съответствие с предвиденото в правилата за управление на риска. ЛУАИФ гарантира, че за Фонда текущото равнище на риск отговаря на нивото, определено от системата за вътрешните рискови лимити. ЛУАИФ установява, прилага и поддържа подходящи процедури, които осигуряват предприемането на навременни коригиращи действия в най-добрия интерес на притежателите на акции, в случай на настъпване на предвиждани/предвидими нарушения на системата за вътрешните рискови лимити. Волатилността на възвръщаемостта е обща индикация относно общото ниво на риска на Фонда отразяваща ефекта на всички съществени рискове, описани в Правилата за оценка и управление на риска на фонда. Доколкото рискови експозиции причиняват флукутации 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. Волатилността се оценява като

се използва седмична възвръщаемост за минали периоди на фонда. Възвръщаемостта, отнасяща се за изчисляване на волатилността се събира от извадков период, покриващ последните 5 години. Тъй като не са налични достатъчно исторически данни за възвръщаемостта на фонда, за допълване на изискуемия петгодишен период с история на възвръщаемостта са използвани данни от Конкорд Фонд - 8 АИФ АД, алтернативен инвестиционен фонд, управляван от УД Конкорд Асет Мениджмънт АД. Волатилността на Фонда се изчислява и след това се привежда на годишна база, като се използва следния стандартен метод:

$$\text{volatility} = \sigma_f = \sqrt{\frac{m}{T-1} \sum_{t=1}^T (r_{f,t} - \bar{r}_f)^2}$$

където възвръщаемостта на фонда ($r_{f,t}$) се измерва през T неприпокриващи се периоди с дюрацията от $1/m$ години. Това означава $m=52$ и $T=260$ за седмична възвръщаемост и $m=12$ и $T=60$ за месечна възвръщаемост; където $\bar{r}_f$ е средната аритметична стойност на възвръщаемостта на фонда за T периодите:

$$\bar{r}_f = \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T r_{f,t}$$

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 юни 2026 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" (17 референтни точки за "клас риск 4" през последните 4 месеца).

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 АИФ са описани в отделен документ, приложен към настоящата информация.
