

ДФФ "ЦКБ-СИЛА" е добровolen пенсионен фонд, учреден и управляван от лицензираното Пенсионноосигурително акционерно дружество "ЦКБ-СИЛА" (лиценз №08/26.10.2000 г.) в съответствие с Кодекса за социално осигуряване, Част втора: Допълнително социално осигуряване.

Важна информация за доброволния пенсионен фонд

ПОАД „ЦКБ-СИЛА“ АД управлява средствата на ДПФ „ЦКБ-СИЛА“ с цел постигане на оптимално равнище на доходност от активите, като фондът възприема умерен рисков профил.

През второто тримесечие на 2022 година ПОАД „ЦКБ-СИЛА“ АД запази диверсифицирането на активите на ДПФ „ЦКБ-СИЛА“.

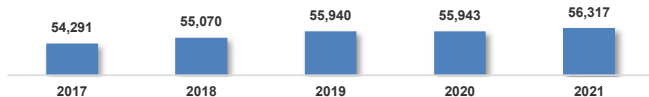
През второто тримесечие на 2022 година ПОАД "ЦКБ-СИЛА" АД се стремеше да ограничи риска от влиянието на международните капиталови пазари. Дружеството запази експозицията в първокласни европейски и американски акции (сини чипове), търгувани на капиталовите пазари в САЩ, Германия, Франция, Холандия, Белгия и Швейцария, включени във водещи индекси като SP500, DAX, CAC-40, AEX, BEL-20, SMI.

Данни за фонда

ДОБРОВОЛЕН ПЕНСИОНЕН ФОНД "ЦКБ-СИЛА"

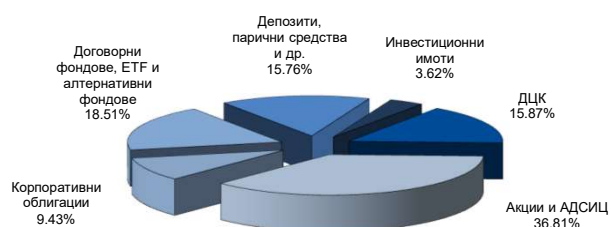
Стартова дата на фонда	13.2.2001
Размер на фонда в лева към 30.06.2022г.	105,569,505
Доходност за 2021 г.	7.00%
Стандартно отклонение за 2021 г.	3.72%
Коефициент на Шарп за 2021 г.	2.01
Номинална стойност на един дял	1 лев (към 01.07.2004 г.)

Брой осигурени лица



Класове активи

Активите на фонда са разпределени в ДЦК 15.87%, корпоративни облигации 9.43%, акции и АДСИЦ 36.81%, дог.фондове, ETFs и алтернативни фондове 18.51%, депозити и парични средства и др. 15.76%, инвестиционни имоти 3.62%.

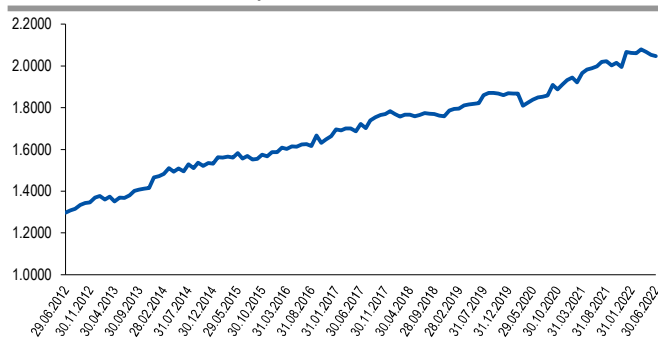


Топ 10 емисии ДЦК в портфейла

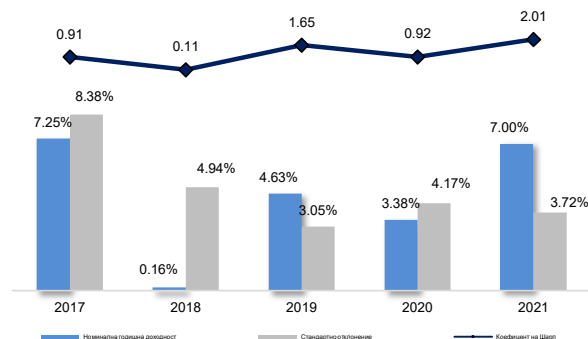
Емисия	% от Активите
ДЦК Република Румъния падеж 2028 г.	3.20%
ДЦК Република Румъния падеж 2025 г.	2.75%
ДЦК Република Албания падеж 2025 г.	1.89%
ДЦК Република Монтенегро падеж 2025 г.	1.69%
ДЦК Република Турция падеж 2025 г.	1.55%
ДЦК Република Румъния падеж 2027 г.	1.48%
ДЦК Република Хърватия падеж 2025 г.	0.96%
ДЦК Република Монтенегро падеж 2029 г.	0.91%
ДЦК Република Полша падеж 2026 г.	0.49%
ДЦК Република България падеж 2027 г.	0.36%

Номиналната доходност на пенсионните фондове е изчислена съгласно чл.10 ал.2 т.1 от Наредба №61 на Комисията за Финансов Надзор. Методиката на изчисленията и значението на показателите за доходност и риск може да намерите на електронната страница на дружеството www.ccb-sila.com или на страницата на КФН www.fsc.bg. Посочените резултати нямат по необходимост връзка с бъдещи резултати. Не се гарантира положителна доходност. Стойността на дяловете може да се понижат. Можете да се запознаете с инвестиционната политика и измененията в нея на електронната страница на Дружеството: www.ccb-sila.com. Данните са актуални към 30.06.2022 г.

Стойност на един дял за период от 06.2012 г. - 06.2022 г.

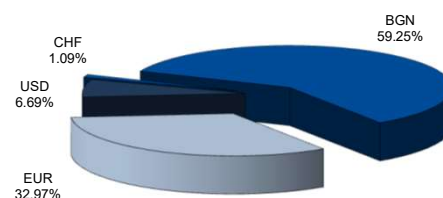


Показатели за доходност и риск

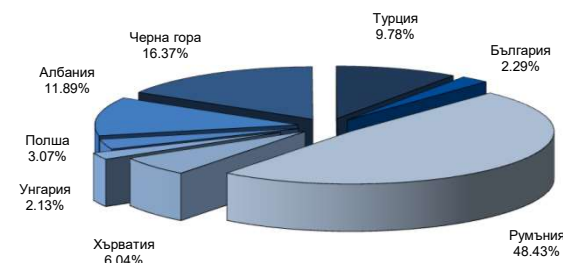


Информация за портфейла към 30.06.2022г.

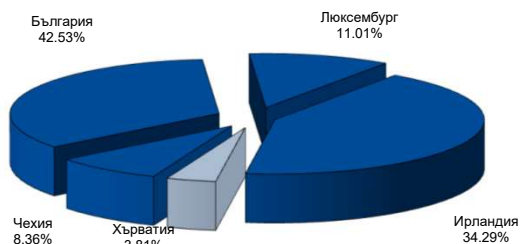
Валутна експозиция на портфейла



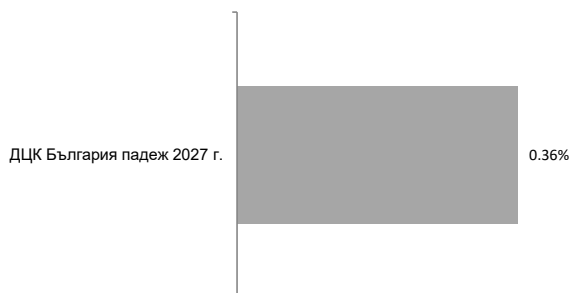
Географско разпределение - Държавни Ценни Книжа ,ЕЦБ и ЕИБ



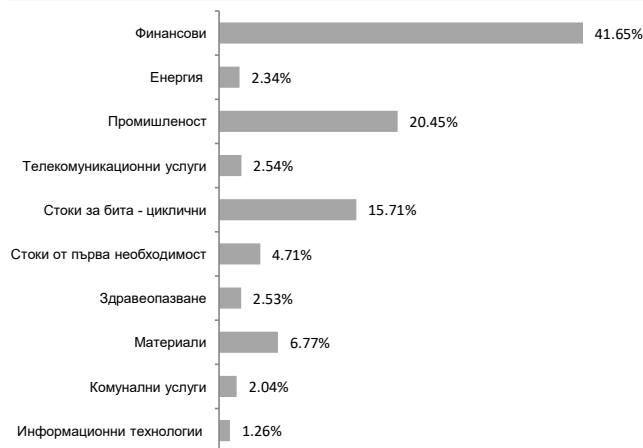
Географско разпределение - корпоративни облигации



Български емисии ДЦК



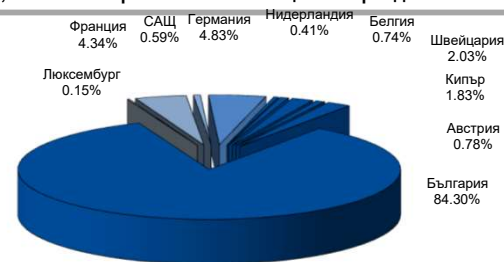
Секторно разпределение на акции и АДСИЦ



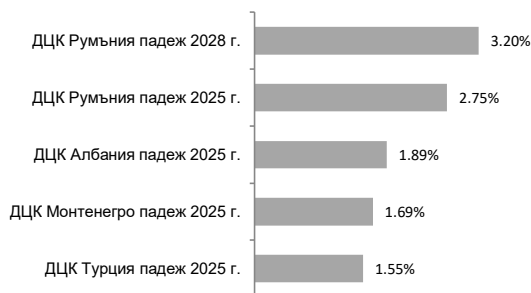
Инвестиционни ограничения, съгласно Кодекс за Социално осигуряване

Инструмент	общо от активите	в емитент
Държавни ценни книжа (държави членки на ЕС и др.)	min 10%, max 80%	не
Акции на регулиран пазар	min 5%, max 50%	5%
Акции на IPO	max 2%	2%
Акции на АДСИЦ	max 10%	5%
Общински ценни книжа	max 10%	5%
Банкови депозити	max 35%	5%
Корпоративни облигации	min 5%, max 45%	5%
Корпоративни облигации на IPO с проспект	max 3%	3%
Новоemitирани обезпечени корпоративни облигации*	max 2%	5%
Корпоративни облигации, издадени или гарантирани от банки за развитие**	max 15%	5%
Колективни инвестиционни схеми	max 30%	10%
Алтернативни инвестиционни фондове	max 2%	2%
Инвестиционни имоти	max 10%	5%

Географско разпределение - Акции, Колективни инвестиционни схеми, ETFs и Алтернативни инвестиционни фондове



Топ 5 чуждестранни емисии ДЦК



Структура по кредитен рейтинг

ДЦК	Рейтинг			% от активите
	Moody's	S&P	Fitch	
Румъния	Baa3	BBB-	BBB-	7.69%
България	Baa1	BBB	BBB	0.36%
Унгария	Baa2	BBB	BBB	0.34%
Хърватия	Ba1	BBB-	BBB	0.96%
Турция	B2	-	B+	1.55%
Полша	A2	A-	A-	0.49%
Албания	B1	B+	-	1.89%
Черна гора	B1	B	-	2.60%