

ДФП "ЦКБ-СИЛА" е доброволен 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.

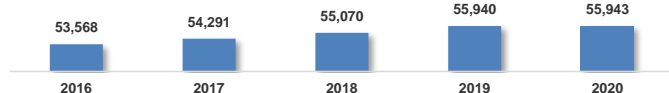
През третото тримесечие на 2021 година ПОАД „ЦКБ-СИЛА“ АД запази диверсифицирането на активите на ДПФ „ЦКБ-СИЛА“.

През третото тримесечие на 2021 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

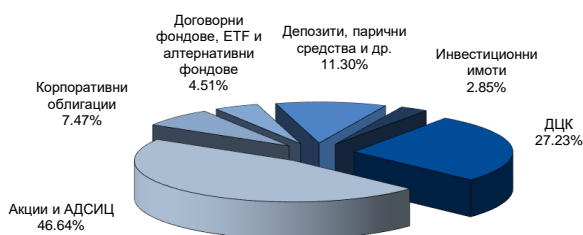
ДОБРОВОЛЕН ПЕНСИОНЕН ФОНД "ЦКБ-СИЛА"	
Стартова дата на фонда	13.2.2001
Размер на фонда в лева към 30.09.2021г.	101,980,892
Доходност за 2020 г.	3.38%
Стандартно отклонение за 2020 г.	4.17%
Коефициент на Шарп за 2020 г.	0.92
Номинална стойност на един дял	1 лев (към 01.07.2004 г.)

Брой осигурени лица



Класове активи

Активите на фонда са разпределени в ДЦК 27.23%, корпоративни облигации 7.47%, акции и АДСИЦ 46.64%, дог.фондове, ETFs и алтернативни фондове 4.51%, депозити и парични средства и др. 11.30%, инвестиционни имоти 2.85%.

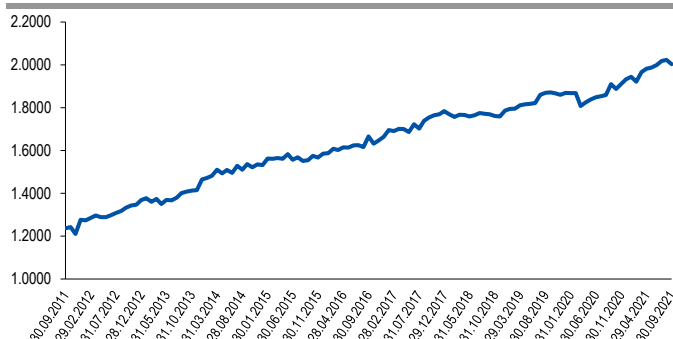


Топ 10 емисии ДЦК в портфейла

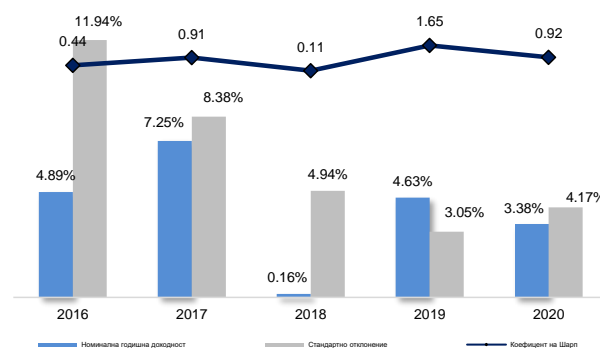
Емисия	% от Активите
ДЦК Република Румъния падеж 2028 г.	4.32%
ДЦК Република Румъния падеж 2025 г.	3.24%
European Investment Bank падеж 2025 г.	2.41%
ДЦК Република Албания падеж 2025 г.	2.32%
ДЦК Република Монтенегро падеж 2025 г.	1.95%
ДЦК Република Румъния падеж 2027 г.	1.90%
ДЦК Република Турция падеж 2025 г.	1.61%
European Investment Bank падеж 2024 г.	1.42%
ОЕКВ OEST.Kontrollbank падеж 2021 г.	1.27%
ДЦК Република Монтенегро падеж 2029 г.	1.24%

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 понижи. Можете да се запознаете с инвестиционната политика и измененията в нея на електронната страница на Дружеството: www.ccb-sila.com. Данните са актуални към 30.09.2021 г.

Стойност на един дял за период от 09.2011 г. - 09.2021 г.

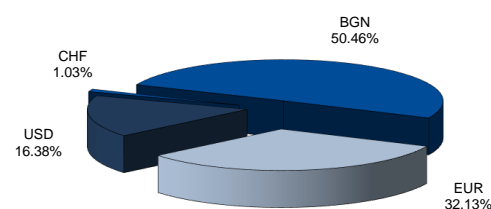


Показатели за доходност и риск

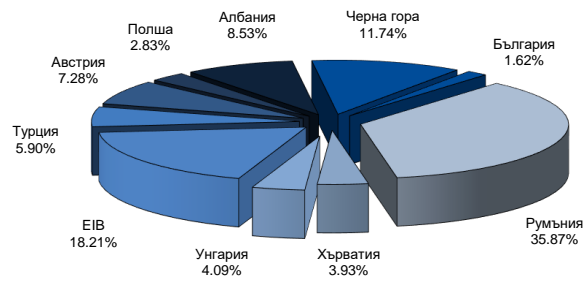


Информация за портфейла към 30.09.2021г.

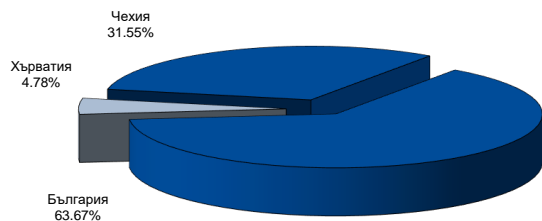
Валутна експозиция на портфейла



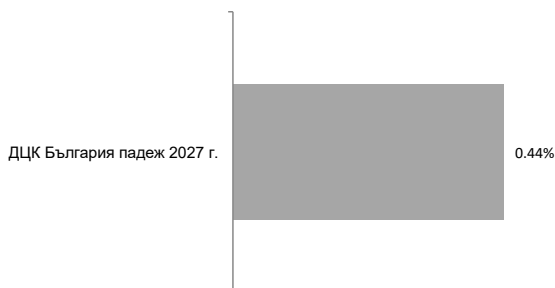
Географско разпределение - Държавни Ценни Книжа ,ЕЦБ и ЕИБ



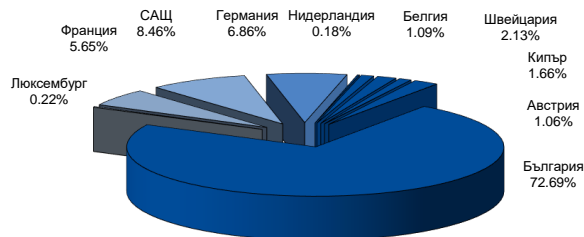
Географско разпределение - корпоративни облигации



Български емисии ДЦК



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



Топ 5 чуждестранни емисии ДЦК



Секторно разпределение на акции и АДСИЦ



Структура по кредитен рейтинг

ДЦК	Рейтинг			% от активите
	Moody's	S&P	Fitch	
Румъния	Baa3	BBB-	BBB-	9.76%
България	Baa1	BBB	BBB	0.44%
Унгария	Baa2	BBB	BBB	1.11%
Хърватия	Ba1	BBB-	BBB-	1.07%
Турция	B2	-	BB-	1.61%
Полша	A2	A-	A-	0.77%
Австрия	Aa1	AA+	AA+	1.98%
EIB	Aaa	AAA	AAA	4.96%
Албания	B1	B+	-	2.32%
Черна гора	B1	B	-	3.20%

Инвестиционни ограничения, съгласно Кодекс за Социално осигуряване

Инструмент	общо от активите	в емитент
Държавни ценни книжа (държавни 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%
Новоемитирани 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%

*Обезпечени корпоративни облигации, за които в решението на общото събрание на акционерите и в предложението за сключване на облигационен заем е поето задължение да се иска приемане и да бъдат приети за търговия на регулиран пазар в срок не по-дълъг от 6 месеца от издаването им и за които е предвидено да бъдат съответно прилагани разпоредбите на Закона за публичното предлагане на ценни книжа относно довереника на облигационерите и обезпечаване на публична емисия облигации;

**Корпоративни облигации, издадени или гарантирани от банки с над 50 на сто държавно участие, получили разрешение за извършване на банкова дейност съгласно законодателството на Република България или друга държава членка, с цел финансиране на дългосрочни и средносрочни инфраструктурни и инвестиционни проекти, за които в решението на общото събрание на акционерите и в предложението за сключване на облигационен заем е поето задължение да се иска приемане и да бъдат приети за търговия на регулиран пазар в срок не по-дълъг от 6 месеца от издаването им.