

ИНФОРМАЦИЯ
ПО ЧЛ. 1056 ОТ ЗДКИСДПКИ КЪМ 31.12.2022 г.

Управляващо дружество „Ди Ви Асет Менеджмънт“ ЕАД (УД/Дружеството) оповестява настоящата информация съгласно изискванията на чл. 1056 от Закона за дейността на колективните инвестиционни схеми и на други предприятия за колективно инвестиране (ЗДКИСДПКИ) и на Директива (ЕС) 2017/828 на Европейския парламент и на Съвета от 17 май 2017 г. за изменение на Директива 2007/36/ЕО по отношение на насърчаването на дългосрочната ангажираност на акционерите. Дружеството има сключен договор за управление на портфейл с лице по чл. 197а, ал. 1 от Кодекса за застраховането – ЗЕАД „Булстрад Живот Виена Иншурънс Груп“, от 02.02.2009 г., като средствата са разпределени в три условни портфейла – „собствени средства“, „здравноосигурителни средства“ и „животозастрахователни резерви“, към всеки от които се прилага съответна инвестиционна политика.

В приетата за 2022 г. Инвестиционна политика по Договора за управление на портфейл на ЗЕАД „Булстрад Живот Виена Иншурънс Груп“ (собствени средства) от 02.02.2009 г., са заложени инвестиционните цели на активите, рисковите ограничения и целевото им разпределение. През периода не е изпълнена заложената в Инвестиционната политика целева доходност.

Състав/структура на портфейла към 31.12.2022 г.	
ЗЕАД „Булстрад Живот Виена Иншурънс Груп“ (собствени средства)	
Инструменти	% от активите
Пари по сметка и вземания	0,76%
ДЦК в BGN	7,96%
ДЦК в EUR	66,45%
Корпоративни облигации EUR	8,52%
Корпоративни облигации - ETF EUR	16,31%
Акции - ETF EUR	0,00%
Общо	100,00%

Основната част от портфейла се състои от ДЦК и корпоративни облигации, съответно основите рискове са пазарният и кредитният риск.

- Пазарният риск се измерва и следи чрез показателя модифицирана дюрация. Съгласно инвестиционната политика целево зададената модифицирана дюрация на портфейла е 7.87, а максималната 10.62. Към 31.12.2022 г. модифицираната дюрация на портфейла е 7.86.
- Кредитният риск на облигациите в портфейлите се следи чрез нивото на кредитните рейтинги на емитентите/емисиите, като се спазват лимити по групи за емитенти и за кредитни рейтинги. С цел намаляване на риска от концентрация, портфейлът е добре диверсифициран по региони и икономически сектори.

Изпълнението на целевото разпределение на активите е както следва:

ЗЕАД „Булстрад Живот Виена Иншурънс Груп“ (собствени средства)				
Иструменти	Мин. по ИП	Макс. по ИП	Целево по ИП	към 31.12.2022
Български ДЦК	0%	75%	9,3%	7,96%
Чуждестранни ДЦК	10%	70%	62,6%	66,45%
Корпоративни облигации(ETF & sinlge names)	0%	45%	27,3%	24,83%
Акции(ETF & sinlge names)	0%	7%	0,6%	0,00%
Пари по сметка и вземания			0,3%	0,76%
Други				
Общо			100%	100,00%

През 2022 г. обръщаемостта на активите за ЗЕАД „Булстрад Живот Виена Иншурънс Груп“ (собствени средства) е 0.51%. Разходите, свързани с обръщаемостта на активите, понижават реализирана доходност с 0.00122%.

В приетата за 2022 г. Инвестиционна политика по Договора за управление на портфейл на ЗЕАД „Булстрад Живот Виена Иншурънс Груп“ (здравноосигурителни средства) от 02.02.2009 г. са заложили инвестиционните цели, на активите, рисковите ограничения и целевото разпределение. През периода не е изпълнена заложената в Инвестиционната политика целева доходност.

Състав/структура на портфейла към 31.12.2022 г. ЗЕАД „Булстрад Живот Виена Иншурънс Груп“ (здравноосигурителни средства)	
Иструменти	% от активите
Пари по сметка и вземания	1,61%
ДЦК в BGN	31,24%
ДЦК в EUR	38,12%
ДЦК в USD	11,68%
Корпоративни облигации EUR	9,65%
КИС EUR	6,78%
Форуръдни контракти	0,92%
Общо	100,00%

Основната част портфейла се състои от ДЦК и корпоративни облигации, съответно основите рискове са пазарният и кредитният риск.

- Пазарният риск се измерва и следи чрез показателя модифицирана дюрация. Съгласно инвестиционната политика целево зададената модифицирана дюрация на портфейла е 3.49, а максималната 5.06. Към 31.12.2022 г. модифицираната дюрация на портфейла е 2.67.



- Кредитният риск на облигациите в портфейлите се следи чрез нивото на кредитните рейтинги на емитентите/емисиите, като се спазват лимити по групи за емитенти и за кредитни рейтинги. С цел намаляване на риска от концентрация, портфейлът е добре диверсифициран по региони и икономически сектори.

Изпълнението на целевото разпределение на активите е както следва:

ЗЕАД „Булстрад Живот Виена Иншурънс Груп” (здравноосигурителни средства)				
Иструменти	Мин. по ИП	Макс. по ИП	Целево по ИП	към 31.12.2022
Български ДЦК	5%	75%	34,50%	31,24%
Чуждестранни ДЦК	10%	70%	36,40%	49,80%
Корпоративни облигации(ETF & single names)	0%	30%	26,80%	16,43%
Акции(ETF & single names)	0%	7%	0,30%	0,00%
Пари по сметка и вземания			2,00%	1,61%
Форуърди				0,92%
Общо			100%	100,00%

През 2022 г. обрачаемостта на активите е 7.74%. Разходите, свързани с обрачаемостта на активите, понижават реализирана доходност с 0.0115%.

В приетата за 2022 г. Инвестиционна политика по Договора за управление на портфейл на ЗЕАД „Булстрад Живот Виена Иншурънс Груп” (животозастрахователни резерви) от 02.02.2009 г. са заложили инвестиционните цели на активите, рисковите ограничения и целевото им разпределение. През периода не е изпълнена заложената в Инвестиционната политика целева доходност.

Състав/структура на портфейла към 31.12.2022 г.	
Иструменти	% от активите
Пари по сметка и вземания	0,17%
ДЦК в BGN	23,88%
ДЦК в EUR	64,59%
ДЦК в USD	2,87%
Корпоративни облигации EUR	3,32%
Корпоративни облигации USD	0,37%
Акции EUR	0,00%
ETF(акции&облигации) EUR	4,57%
Форуърди	0,22%
Общо	100,00%

Основната част от портфейла се състои от ДЦК и корпоративни облигации, съответно основите рискове са пазарният и кредитният риск.

- Пазарният риск се измерва и следи чрез показателя модифицирана дюрация. Съгласно инвестиционната политика целево зададената модифицирана дюрация на портфейла е 8,46, а максималната 11.85. Към 31.12.2022 г. модифицираната дюрация на портфейла е 7.62.
- Кредитният риск на облигациите в портфейлите се следи чрез нивото на кредитните рейтинги на емитентите/емисиите, като се спазват лимити по групи за емитенти и за кредитни рейтинги. С цел намаляване на риска от концентрация, портфейлът е добре диверсифициран по региони и икономически сектори.

Изпълнението на целевото разпределение на активите е както следва:

ЗЕАД „Булград Живот Виена Иншурънс Груп“ (животозастрахователни резерви)				
Иструменти	Мин. по ИП	Макс. по ИП	Целево по ИП	към 31.12.2022
Български ДЦК	10%	75%	53,4%	51,23%
Чуждестранни ДЦК	10%	70%	34,8%	40,11%
Корпоративни облигации(ETF & sinlge names)	0%	20%	10,2%	7,96%
Акции(ETF & sinlge names)	0%	7%	1,4%	0,31%
Пари по сметка и вземания			0,2%	0,17%
Други			0,0%	0,22%
Общо			100%	100,00%

През 2022 г. обръщаемостта на активите е 8.79%. Разходите, свързани с обръщаемостта на активите, понижават реализирана доходност с 0.00042%.

През 2022 г. не са използвани упълномощени съветници по смисъла на § 1, т. 55 от допълнителните разпоредби на Закона за публичното предлагане на ценни книжа.

През 2022 г. не са възниквали конфликти на интереси във връзка изпълнението на дейностите по ангажираността.

През 2022 г. са извършвани сделки за покупко-продажба на акции на дружества със седалище в държава членка, допуснати до търговия на регулиран пазар в държава членка, с цел реализиране на положителен резултат от краткосрочни движения на пазара. Вземането на решения за сделките се базира на наблюдение и анализиране на компаниите и пазарите.

Дата на публикуване: 30.03.2023 г.



Иван Балтов

Изпълнителен директор

Елеонора Стоева

Прокурист