

**Информация от НАЦИОНАЛЕН ДОГОВОРЕН ФОНД „АКТИВА“
на основание чл. 236, ал. 1, т. 2, букви “а-в” от ЗДКИСДПКИ
във връзка с чл. 237, ал. 3, т. 1**

- **Дял на активите на НДФ, които са обект на специално третиране поради ниската им ликвидност:**

Към 31.12.2023 г. НДФ „Актива“ не е инвестирал в активи, които са обект на специално третиране поради ниската им ликвидност.

В портфейла на фонда извънборсовите ценни книжа към 31.12.2023 г. имат дял от 19.56% от активите, но те не попадат в дефиницията по чл. 234 от ЗДКИСДПКИ.

- **Прилагани нови подходи за управление на ликвидността на НДФ:**

През периода 01.10.2023 г. – 31.12.2023 г. не са използвани нови подходи за управление на ликвидността на АИФ при управлението на НДФ „Актива“. Подходите за управление на ликвидността на АИФ при управлението на НДФ „Актива“ са описани в Правилата за поддържане и управление на ликвидността на НДФ „Актива“ и Правила за оценка и управление на риска на НДФ „Актива“.

- **Текущ рисков профил на НДФ:**

Индикаторът на риска и на доходността дава насока относно нивото на риск на НДФ „Актива“ и потенциала му за реализиране на доход. Колкото по-голямо е числото, толкова по-голям е потенциалът на растеж, но и рискът да се загубят пари.

НДФ „Актива“ поема умерен към висок риск, като инвестициите са основно в ликвидни акции. С оглед занижаване на риска, Фондът формира и инвестиционна компонента в дългови ценни книжа. Тъй като няма натрупана история, Управляващото дружество приема SOFIX за бенчмарк за Фонда. Изчисляването на синтетичния индикатор за риск и доходност се определя, като към налична история на възвращаемостта на фонда се добавят калибрираните данни за SOFIX.

Към края на месец декември 2023 г. НДФ „Актива“ е определен в категория 5-та степен по 7-степенната скала на индикатора, на база стойността на показателя "стандартно отклонение", определена съгласно насоките на CESR. За изчисляване на общата рискова експозиция Фондът използва метода на поетите задължения.

- **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 Правилата за поддържане и управление на ликвидността на НДФ „Актива“ и Правила за оценка и управление на риска на НДФ „Актива“.