Информация от НАЦИОННАЛЕН ДОГОВОРЕН ФОНД „ЕФ ПОТЕНЦИАЛ“
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 30.06.2025г. НДФ „ЕФ Потенциал” не е инвестирал в активи, които са обект на специално третиране поради ниската им ликвидност.
В портфейла на фонда извънборсовите ценни книжа към 30.06.2025 г. имат дял от 23.42% от активите, но те не попадат в дефиницията по чл. 234 от ЗДКИСДПКИ.

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

През периода 01.04.2025 г. – 30.06.2025 г. не са използвани нови подходи за управление на ликвидността на АИФ при управлението на НДФ „ЕФ Потенциал”. Подходите за управление на ликвидността на АИФ при управлението на НДФ „ЕФ Потенциал” са описани в Правилата за поддържане и управление на ликвидността на НДФ „ЕФ Потенциал” и Правила за оценка и управление на риска на НДФ „ЕФ Потенциал”.

- **Текущ рисков профил на НДФ:**

Индикаторът на риска и на доходността дава насока относно нивото на риск на НДФ „ЕФ Потенциал” 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 „ЕФ Потенциал” 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.

Фонда изчислява риска съобразно обобщен показател за риска(ОПР), като същия е основан на 5 годишен хоризонт на задържане на инвестицията. ОПР показва вероятността от парична загуба в резултат на пазарната динамика.

Съгласно приетата методология, към края на месец юни 2025 г., на фонда е определена категория на риск 4 от общо 7 степени, отговаряща на среден риск. ОПР има за цел да предостави насока относно нивото на риска на фонда и потенциала му за реализиране на доход.

- **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 „ЕФ Потенциал” и Правила за оценка и управление на риска на НДФ „ЕФ Потенциал“.