

ИНФОРМАЦИЯ
СЪГЛАСНО ЧЛ. 72 ОТ НАРЕДБА № 44 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ
ДЕЙНОСТТА НА КИС, УД, НАЦИОНАЛНИТЕ ИНВЕСТИЦИОННИ ФОНДОВЕ
И ЛИЦАТА, УПРАВЛЯВАЩИ АЛТЕРНАТИВНИ ИНВЕСТИЦИОННИ
ФОНДОВЕ

ДФ ДИ ВИ ДИНАМИК

Към 31.12.2020 г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ди Ви Динамик са разпределени в 6 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 31.12.2020 г. възлиза на 28.65%.

Делът на борсово търгуваните фондове (Акции) е 37.65% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.12.2020 г. са 33.54% от стойността на портфейла.

Вземанията от хеджиране, възлизат на 0.16% от активите на Фонда.

На 31.12.2020 г. нетната стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик е 897 213 лв., а нетната стойност на активите на един дял е 8.1260 лв.

I. Данни по чл. 72, ал. 2 от Наредба № 44

1. Данни по чл. 72, ал. 2, т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти

Структурата на портфейла на ДФ Ди Ви Динамик към 31.12.2020 г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ "Ди Ви Динамик" към 31.12.2020 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции	258 470	28.65%
Борсово Търгувани Фондове (Акции)	339 526	37.65%
В брой и разплащателни сметки	302 490	33.54%
Вземания*	1 428	0.16%
Общо активи	901 914	100.00%

* Вземания във връзка с начислени дивиденди, лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, предварително платени такси към КФН, вземания от хеджиране и др.



2. Данни по чл. 72, ал. 2, т. 2: Видове деривативни инструменти, основни рискове, свързани с базовите активи на деривативните инструменти, количествени ограничения и избрани методи за оценка на риска, свързан със сделките с деривативни инструменти

Към настоящия момент, сключените от управляващото дружество сделки с деривативни инструменти са единствено с цел управление на риска – хеджиране.

Във връзка с притежаваните от Фонда валутно деноминирани активи, управляващото дружество извършва хеджиращи сделки с цел предпазване от валутния риск, на който е изложен Фонда. Хеджираните активи и сключените сделки са описани по-долу.

Рисков актив				
ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
Валутно деноминиран актив	USD	26 712.240	1.0000	\$26 712.24
Валутно деноминиран актив	USD	350.000	136.730	\$47 855.50
Валутно деноминиран актив	USD	546.000	67.880	\$37 062.48
Обща рискова позиция				\$111 630.22

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 87 000.00	1.216800	\$105 861.60	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$105 861.60		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД