

**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

Съгласно инвестиционната политика и стратегия на Фонда за инвестиране предимно в акции, търгувани на регулираните пазари в страната и чужбина, през месец февруари има продажби на борсово търгувани фондове (акции).

Към 28.02.2020 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 28.02.2020 г. възлиза на 30.81%.

Делът на борсово търгуваните фондове (Акции) е 44.53% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 28.02.2020 г. са 21.89% от стойността на портфейла.

Вземанията по договор за цесия и вземания от хеджиране, възлизат на 2.77% от активите на Фонда.

На 28.02.2020 г. нетната стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик е 887 975 лв., а нетната стойност на активите на един дял е 7.9478 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 28.02.2020 г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ "Ди Ви Динамик" към 28.02.2020 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции	283 485	30.81%
Борсово Търгувани Фондове (Акции)	409 753	44.53%
В брой и разплащателни сметки	201 365	21.89%
Вземания*	25 486	2.77%
Общо активи	920 089	100.00%

* Вземания по договор за цесия ,вземания от хеджиране и предварително платени такси към КФН.



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	2 013.750	1.0000	\$2 013.75
Валутно деноминиран актив	USD	121.000	205.800	\$24 901.80
Валутно деноминиран актив	USD	350.000	121.150	\$42 402.50
Валутно деноминиран актив	USD	546.000	61.270	\$33 453.42
Обща рискова позиция				\$102 771.47

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 64 000.00	1.089950	\$69 756.80	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 44 000.00	1.084840	\$47 732.96	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$117 489.76		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД