

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 периода продължават покупките и продажбите на акции от български публични дружества, търгувани на БФБ – София АД.

Към 30.11.2016 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 30.11.2016 г. възлиза на 28.46%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 58.18% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Към 30.11.2016 г. корпоративните облигации представляват 0.87% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.11.2016 г. са 8.23% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии и вземане от хеджиране възлизат на 4.26% от активите на Фонда.

На 30.11.2016 г. нетната стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик е 1 178 551 лв., а нетната стойност на активите на един дял е 7.3796 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 30.11.2016 г. е представена в следната таблица и графика.

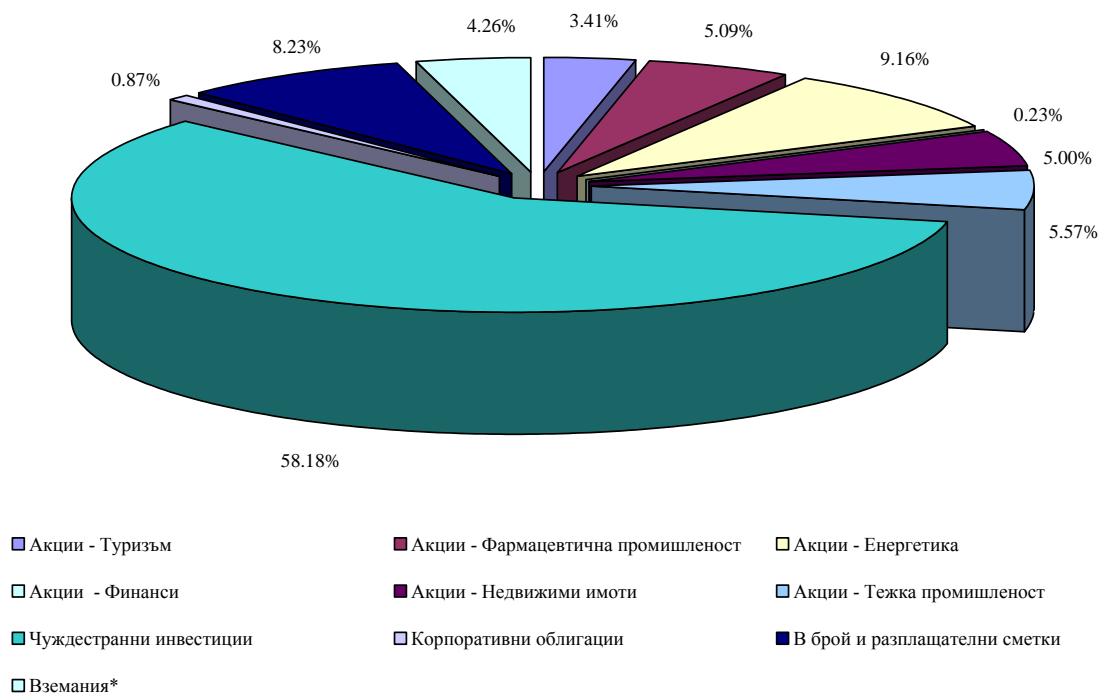


Структура на портфейла на ДФ "Ди Ви Динамик" към 30.11.2016 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
<i>Акции - Туризъм</i>	40 385	3.41%
<i>Акции - Фармацевтична промишленост</i>	60 225	5.09%
<i>Акции - Енергетика</i>	108 397	9.16%
<i>Акции - Финанси</i>	2 750	0.23%
<i>Акции - Недвижими имоти</i>	59 098	5.00%
<i>Акции - Тежка промишленост</i>	65 858	5.57%
<i>Чуждестранни инвестиции</i>	688 215	58.18%
<i>Корпоративни облигации</i>	10 310	0.87%
<i>В брой и разплащателни сметки</i>	97 328	8.23%
<i>Вземания*</i>	50 450	4.26%
<i>Общо активи</i>	1 183 016	100.00%

* Вземания във връзка с главница и лихва по облигационни емисии и вземане от хеджиране.



Разпределение на активите на Ди Ви Динамик към 30/11/2016



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	821.710	1.0000	\$821.71
Валутно деноминиран актив	USD	1 000.000	44.450	\$44 450.00
Валутно деноминиран актив	USD	337.000	117.500	\$39 597.50
Валутно деноминиран актив	USD	1 405.000	38.550	\$54 162.75
Валутно деноминиран актив	USD	200.000	220.3800	\$44 076.00
Обща рискова позиция				\$183 107.96

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 100 000.00	1.057360	\$105 736.00	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 68 000.00	1.062290	\$72 235.72		
Обща хеджираща позиция				\$177 971.72		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД