



**ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО
ЧЛ. 73 (1) Т.5 ОТ НАРЕДБА № 44 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА
НА КИС, УД, НАЦИОНАЛНИТЕ ИНВЕСТИЦИОННИ ФОНДОВЕ И ЛИЦАТА,
УПРАВЛЯВАЩИ АЛТЕРНАТИВНИ ИНВЕСТИЦИОННИ
ФОНДОВЕ**

ДОГОВОРЕН ФОНД „ДИ ВИ ДИНАМИК”

I. Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5 от Наредба № 44, във връзка с чл.75, т.2

**1) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5, б. „г”: Промени в структурата на портфейла
през отчетния период**

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. Закупени са и са продадени чуждестранни инвестиции.

Към 30.06.2017г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ди Ви Динамик са разпределени в 5 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 30.06.2017 г. възлиза на 28.19%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 46.26% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Към 30.06.2017г. корпоративните облигации представляват 0.76% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.06.2017г. са 20.28% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, вземанията от хеджиране и вземанията от дивиденди възлизат на 4.51% от активите на Фонда.

На 30.06.2017г. нетната стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик е 1,281,266 лв., а нетната стойност на активите на един дял е 8.4821 лв.

**2) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б. „а” и „д”: Промени в състоянието на
активите в рамките на отчетния период**

Долната таблица представя приходите на Фонда към 30.06.2017г. Приходите са в размер на 618,195 лв., включващи приходи от операции с финансови активи, приходи от лихви, положителни курсови разлики и други финансови приходи.



Приходи	Стойност в лева		
	30/06/16	31/12/16	30/06/17
Приходи от лихви	1,593	3,141	1,403
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	510,970	973,991	439,119
Положителни курсови разлики	198,812	363,620	167,985
Други финансови приходи	8,130	19,249	9,688
Общо приходи:	719,505	1,360,001	618,195

Разходите на Фонда за отчетния период са представени в таблицата по-долу:

Разходи	Стойност в лева		
	30/06/16	31/12/16	30/06/17
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	590,514	947,547	297,067
Отрицателни курсови разлики	200,803	369,182	169,806
Разходи за външни услуги	14,912	29,203	14,804
Други финансови разходи	54,066	55,370	1,031
Общо разходи:	860,295	1,401,302	482,708

Общият размер на разходите на фонда към 30.06.2017г. е 482,708 лева, които включват 297,067 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти, 169,806 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове.

а) Възнаграждение на управляващото дружество
- към 30.06.2017г. – 11,242 лв.
- като процент от средната нетна стойност на активите за отчетния период:
0.89%

б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество
- към 30.06.2017г. – 192 лв.
- като процент от средната нетна стойност на активите за отчетния период:
0.02%

в) Възнаграждение на банката депозитар
- към 30.06.2017г. – 1,200 лв.
- като процент от средната нетна стойност на активите за отчетния период:
0.10%

г) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие
- към 30.06.2017г. – 1,800 лв.
- като процент от средната нетна стойност на активите за отчетния период:
0.14%



д) Други разходи
- към 30.06.2017г. – 1,401 лв.
- като процент от средната нетна стойност на активите за отчетния период:
0.11%

- Други разходи по финансови операции: 839 лв.
- Външни услуги (КФН, ЦД и други услуги): 562 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 15,835 лв. към месец юни 2017. Като процент от средната нетна стойност на активите за отчетния период тези разходи са: 1.26%.

	Стойност в лева		
	30/06/16	31/12/16	30/06/17
Общо Приходи	719,505	1,360,001	618,195
Общо Разходи	860,295	1,401,302	482,708
Нетен Резултат	(140,790)	(41,301)	135 487

За периода са записани 2 931.0725 и са обратно изкупени 11 578.5256 броя дялове. НСА на фонда към 30.06.2016г. е 1,165,167 лв., към 31.12.2016 г. е 1,216,395 лв., а към 30.06.2017г. е 1,281,266 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 151 056.1595.

3) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б. „в” и „г”: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

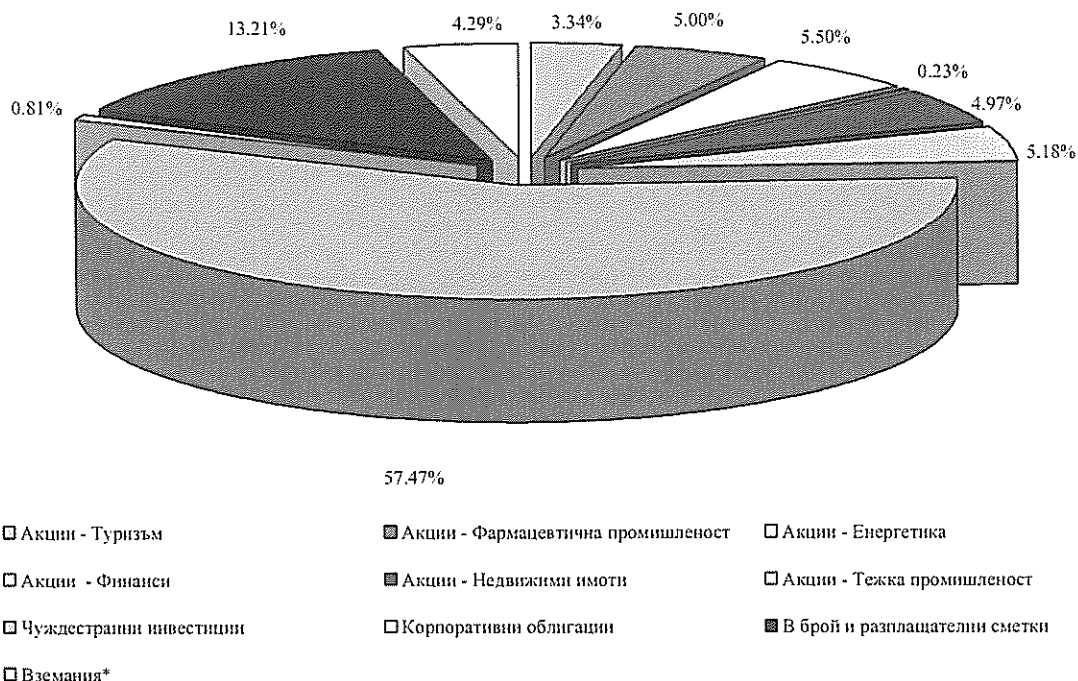
Структурата на портфейла на ДФ Ди Ви Динамик в края на периода е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ „Ди Ви Динамик“

Актив	Стойност в лева 31.12.2016	Процент от активите 31.12.2016	Стойност в лева 30.06.2017	Процент от активите 30.06.2017	Валута (EUR, USD, BGN)
Акции - Туризм	40,733	3.34%	0	0.00%	BGN
Акции - Фармацевтична промишленост	61,022	5.00%	75,194	5.85%	BGN
Акции - Финанси	2,798	0.23%	47,830	3.72%	BGN
Акции-Тежка промишленост	63,254	5.18%	89,560	6.97%	BGN
Акции - Недвижими имоти	60,678	4.97%	63,662	4.96%	BGN
Акции - Енергетика	67,200	5.50%	85,908	6.69%	BGN
Корпоративни облигации	9,830	0.81%	9,754	0.76%	EUR
Чуждестранни инвестиции	701,784	57.47%	594,029	46.26%	USD, EUR
Парични средства	161,365	13.21%	260,416	20.28%	BGN, EUR, USD
Вземания*	52,412	4.29%	57,934	4.51%	BGN
Общо активи	1,221,076	100.00%	1,284,287	100.00%	EUR, USD, BGN

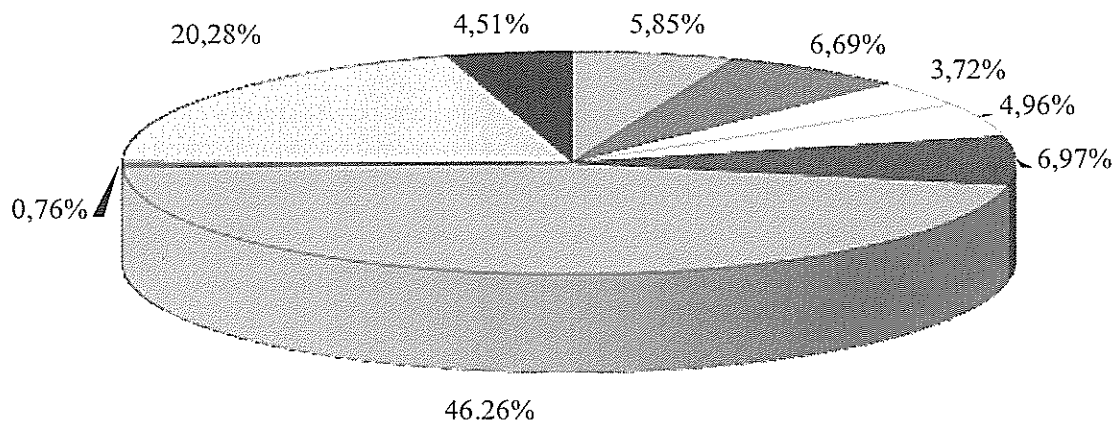
* Вземания във връзка с начислени дивиденди и лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации и вземания от хеджиране.

Разпределение на активите на Ди Ви Динамик към 31/12/2016





Разпределение на активите на Ди Ви Динамик към 30/06/2017



- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Финанси
- Акции - Тежка промишленост
- Корпоративни облигации
- Вземания*

- Акции - Енергетика
- Акции - Недвижими имоти
- Чуждестранни инвестиции
- В брой и разплащателни сметки

4) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б. „б“: Нетна стойност на активите на един дял

Към 30.06.2016 г. нетна стойност на активите на един дял е 7.0023 лв. На 31.12.2016 г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 7.6166 лв. Към 30.06.2017 г. нетната стойност на активите на един дял е 8.4821 лв.

Изменението на нетната стойност на активите на Фонда е представено на следващата графика.



5) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5, б. „е“: Сравнителна таблица за последните три периода, включваща общата стойност на нетните активи и нетна стойност на един дял

	30/06/2016 (лв)	31/12/2016 (лв)	30/06/2017 (лв)
Нетна стойност на активите на „Ди Ви Динамик“	1,165,167	1,216,395	1,281,266
Нетна стойност на активите на един дял	7.0023	7.6166	8.4821

б) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5, б. „ж“: задължения, възникнали от сделки 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	32 859.420	1.0000	\$32 859.42
Валутно деноминиран актив	USD	129.000	241.800	\$31 192.20
Валутно деноминиран актив	USD	337.000	137.640	\$46 384.68
Валутно деноминиран актив	USD	837.000	48.930	\$40 954.41
Валутно деноминиран актив	USD	350.000	116.430	\$40 750.50
Обща рискова позиция				\$192 141.21

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 100 000.00	1.118600	\$111 860.00	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 77 000.00	1.120760	\$86 298.52		
Обща хеджираща позиция				\$198 158.52		


Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД




Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД