



**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 на акции от български публични дружества, търгувани на БФБ – София АД. Закупени са и чуждестранни инвестиции.

Към 31.08.2017г. 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 31.08.2017 г. възлиза на 27.82%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 53.27% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Към 31.08.2017г. корпоративните облигации представляват 0.95% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.08.2017г. са 12.98% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, вземанията от хеджиране и по сделки с ценни книжа и вземанията от дивиденди възлизат на 4.98% от активите на Фонда.

На 31.08.2017г. нетната стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик е 1 272 793 лв., а нетната стойност на активите на един дял е 8.5667 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 31.08.2017г. е представена в следната таблица и графика.

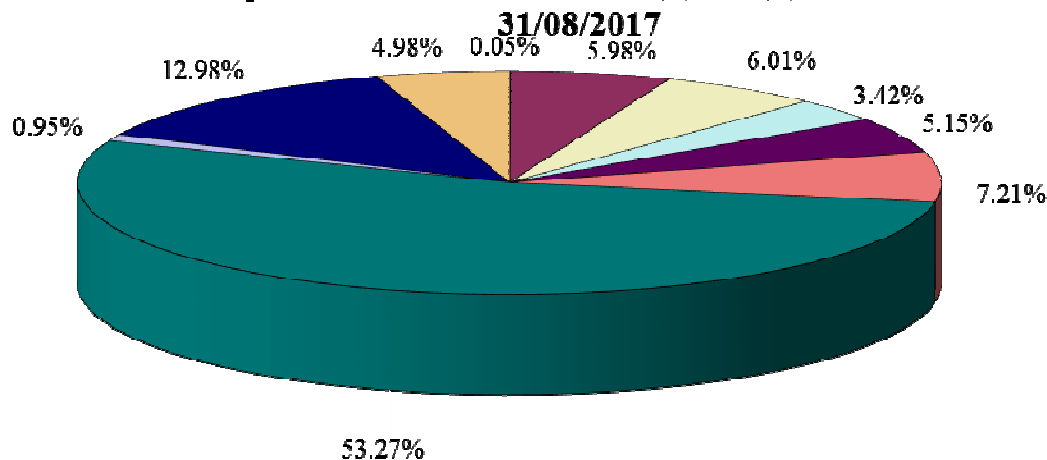


Структура на портфейла на ДФ "Ди Ви Динамик" към 31.08.2017 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Туризъм	641	0.05%
Акции - Фармацевтична промишленост	77 549	5.98%
Акции - Енергетика	77 892	6.01%
Акции - Финанси	44 335	3.42%
Акции - Недвижими имоти	66 781	5.15%
Акции - Тежка промишленост	93 450	7.21%
Чуждестранни инвестиции	690 428	53.27%
Корпоративни облигации	12 308	0.95%
В брой и разплащателни сметки	168 276	12.98%
Вземания*	64 553	4.98%
Общо активи	1 296 213	100.00%

* Вземания във връзка с главница и лихва по облигационни емисии , вземания от хеджиране и от сделки с ценни книжа и вземания от дивиденди.

Разпределение на активите на Ди Ви Динамик към

31/08/2017



- Акции - Туризъм
- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Енергетика
- Акции - Финанси
- Акции - Недвижими имоти
- Акции - Тежка промишленост
- Чуждестранни инвестиции
- Корпоративни облигации
- В брой и разплащателни сметки
- Вземания*



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	33 220.800	1.0000	\$33 220.80
Валутно деноминиран актив	USD	129.000	247.490	\$31 926.21
Валутно деноминиран актив	USD	337.000	146.200	\$49 269.40
Валутно деноминиран актив	USD	837.000	50.300	\$42 101.10
Валутно деноминиран актив	USD	350.000	115.790	\$40 526.50
Обща рискова позиция				\$197 044.01

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 100 000.00	1.178860	\$117 886.00	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 70 000.00	1.177130	\$82 399.10		
Обща хеджираща позиция				\$200 285.10		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД



**Асет
Мениджмънт**

VIENNA INSURANCE GROUP

1113 София, ул Тинтява 13Б, ет. 2
тел.: 029350633, факс: 029350617

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД