



**ИНФОРМАЦИЯ  
СЪГЛАСНО ЧЛ. 72 ОТ НАРЕДБА № 44 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ  
ДЕЙНОСТТА НА КИС, ИД ОТ ЗАТВОРЕН ТИП И УД**

**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. Закупени са и чуждестранни инвестиции.

Към 31.05.2016 г. 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 31.05.2016 г. възлиза на 26.68%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 55.52% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Към 31.05.2016 г. корпоративните облигации представляват 3.30% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.05.2016 г. са 7.39% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии и вземане по договор възлизат на 7.11% от активите на Фонда.

На 31.05.2016 г. нетната стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик е 1 244 617 лв., а нетната стойност на активите на един дял е 7.3970 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**

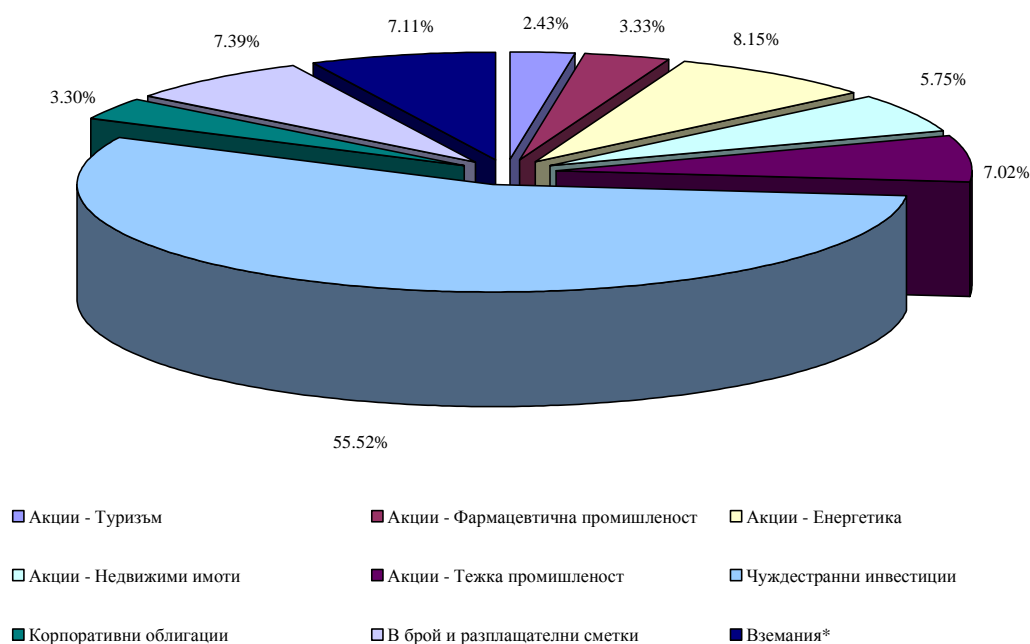
Структурата на портфейла на ДФ Ди Ви Динамик към 31.05.2016 г. е представена в следната таблица и графика.



| Структура на портфейла на ДФ "Ди Ви Динамик" към 31.05.2016 г. |                 |                     |
|--|-----------------|---------------------|
| Актив  | Стойност в лева | Процент от активите |
| Акции - Туризъм  | 30 416          | 2.43%               |
| Акции - Фармацевтична промишленост                             | 41 793          | 3.33%               |
| Акции - Енергетика   | 102 154         | 8.15%               |
| Акции - Недвижими имоти  | 72 093          | 5.75%               |
| Акции - Тежка промишленост                                     | 87 970          | 7.02%               |
| Чуждестранни инвестиции  | 696 116         | 55.52%              |
| Корпоративни облигации   | 41 318          | 3.30%               |
| В брой и разплащателни сметки                                  | 92 670          | 7.39%               |
| Вземания*  | 89 185          | 7.11%               |
| Общо активи  | 1 253 715       | 100.00%             |

\* Вземания във връзка с главница и лихва по облигационни емисии и вземане по договор.

Разпределение на активите на Ди Ви Динамик към 31/05/2016



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.

| <b>Рисков актив</b>         |               |             |             |                      |
|-----------------------------|---------------|-------------|-------------|----------------------|
| <b>ISIN</b>                 | <b>Валута</b> | <b>Брой</b> | <b>Цена</b> | <b>Обща Стойност</b> |
| Валутно деноминиран актив   | USD           | 1 388.810   | 1.0000      | \$1 388.81           |
| Валутно деноминиран актив   | USD           | 1 000.000   | 44.460      | \$44 460.00          |
| Валутно деноминиран актив   | USD           | 337.000     | 110.340     | \$37 184.58          |
| Валутно деноминиран актив   | USD           | 1 405.000   | 36.890      | \$51 830.45          |
| Валутно деноминиран актив   | USD           | 200.000     | 209.8400    | \$41 968.00          |
| <b>Обща рискова позиция</b> |               |             |             | \$176 831.84         |

| <b>Деривативен инструмент</b> |               |              |             |                      |              |                |
|-------------------------------|---------------|--------------|-------------|----------------------|--------------|----------------|
| <b>Вид</b>                    | <b>Валута</b> | <b>Брой</b>  | <b>Цена</b> | <b>Обща Стойност</b> | <b>Пазар</b> | <b>Държава</b> |
| Форуърд купува EUR/USD        | EUR/USD       | € 100 000.00 | 1.140560    | \$114 056.00         | OTC          | България       |
| Форуърд купува EUR/USD        | EUR/USD       | € 54 000.00  | 1.116060    | \$60 267.24          |              |                |
| <b>Обща хеджираща позиция</b> |               |              |             | \$174 323.24         |              |                |

Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД