



**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. Закупени са и са продадени чуждестранни инвестиции.

Към 31.01.2017г. 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 31.01.2017г. възлиза на 26.02%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 55.78% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Към 31.01.2017г. корпоративните облигации представляват 0.89% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.01.2017г. са 13.24% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии и вземанията от хеджиране възлизат на 4.07% от активите на Фонда.

На 31.01.2017г. нетната стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик е 1 246 017 лв., а нетната стойност на активите на един дял е 7.8215 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

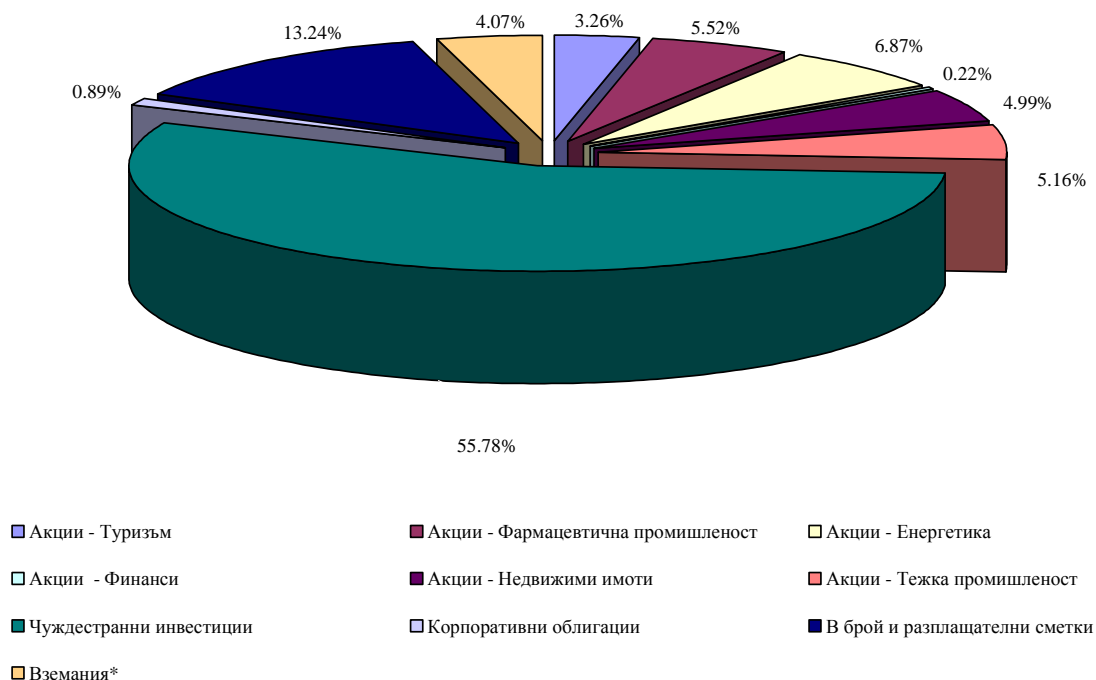
Структурата на портфейла на ДФ Ди Ви Динамик към 31.01.2017г. е представена в следната таблица и графика.



Структура на портфейла на ДФ Ди Ви Динамик към 31.01.2017 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Туризъм	40 763	3.26%
Акции - Фармацевтична промишленост	69 053	5.52%
Акции - Енергетика	85 923	6.87%
Акции - Финанси	2 750	0.22%
Акции - Недвижими имоти	62 425	4.99%
Акции - Тежка промишленост	64 589	5.16%
Чуждестранни инвестиции	697 947	55.78%
Корпоративни облигации	11 105	0.89%
В брой и разплащателни сметки	165 631	13.24%
Вземания*	50 905	4.07%
Общо активи	1 251 091	100.00%

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

Разпределение на активите на Ди Ви Динамик към 31/01/2017





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	730.150	1.0000	\$730.15
Валутно деноминиран актив	USD	259.000	227.530	\$58 930.27
Валутно деноминиран актив	USD	337.000	124.570	\$41 980.09
Валутно деноминиран актив	USD	387.000	101.970	\$39 462.39
Валутно деноминиран актив	USD	350.000	112.710	\$39 448.50
Обща рискова позиция				\$180 551.40

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 100 000.00	1.074200	\$107 420.00	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 68 000.00	1.066400	\$72 515.20		
Обща хеджираща позиция				\$179 935.20		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов



**Асет
Мениджмънт**

VIENNA INSURANCE GROUP

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

Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД