



**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 са продадени и чуждестранни инвестиции.

Към 30.09.2016 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 30.09.2016 г. възлиза на 30.29%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 56.77% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Към 30.09.2016 г. корпоративните облигации представляват 0.72% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.09.2016 г. са 6.81% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии и вземане от дивиденди възлизат на 5.41% от активите на Фонда.

На 30.09.2016 г. нетната стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик е 1 188 346 лв., а нетната стойност на активите на един дял е 7.2673 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 30.09.2016 г. е представена в следната таблица и графика.

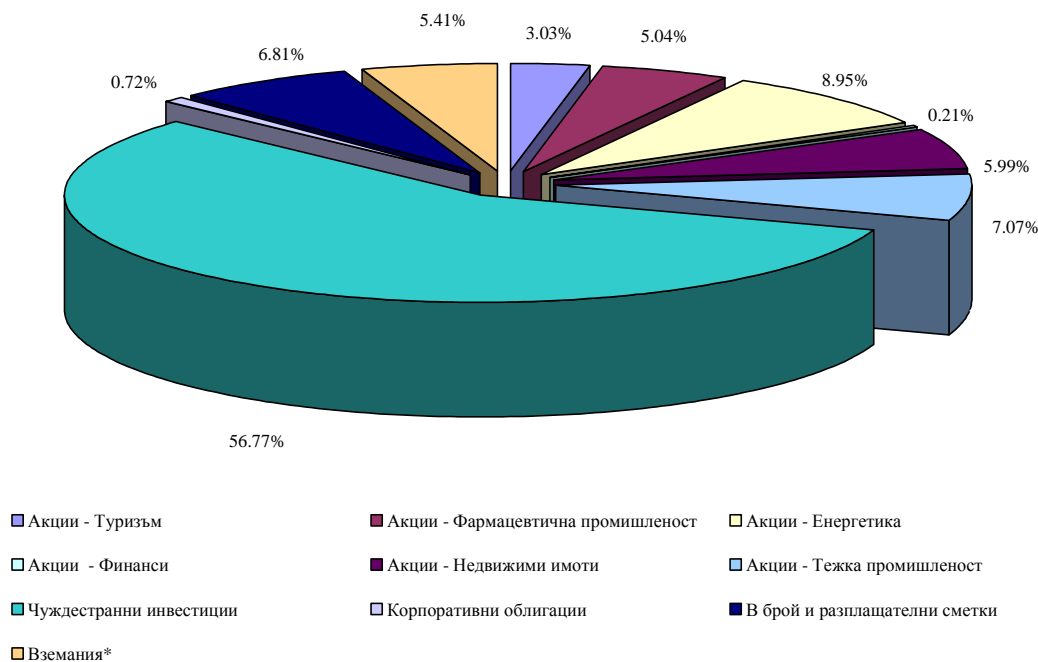


Структура на портфейла на ДФ "Ди Ви Динамик" към 30.09.2016 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
<i>Акции - Туризъм</i>	36 249	3.03%
<i>Акции - Фармацевтична промишленост</i>	60 196	5.04%
<i>Акции - Енергетика</i>	106 906	8.95%
<i>Акции - Финанси</i>	2 538	0.21%
<i>Акции - Недвижими имоти</i>	71 492	5.99%
<i>Акции - Тежка промишленост</i>	84 525	7.07%
<i>Чуждестранни инвестиции</i>	678 277	56.77%
<i>Корпоративни облигации</i>	8 575	0.72%
<i>В брой и разплащателни сметки</i>	81 328	6.81%
<i>Вземания*</i>	64 679	5.41%
<i>Общо активи</i>	1 194 765	100.00%

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



Разпределение на активите на Ди Ви Динамик към 30/09/2016



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	2 374.800	1.0000	\$2 374.80
Валутно деноминиран актив	USD	1 000.000	45.430	\$45 430.00
Валутно деноминиран актив	USD	337.000	118.720	\$40 008.64
Валутно деноминиран актив	USD	1 405.000	38.910	\$54 668.55
Валутно деноминиран актив	USD	200.000	216.3000	\$43 260.00
Обща рискова позиция				\$185 741.99

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 100 000.00	1.124280	\$112 428.00	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 68 000.00	1.117030	\$75 958.04		
Обща хеджираща позиция				\$188 386.04		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД