

**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 месец май има продажби на борсово търгувани фондове (акции).

Към 29.05.2020 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 29.05.2020 г. възлиза на 28.42%.

Делът на борсово търгуваните фондове (Акции) е 36.10% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 29.05.2020 г. са 34.91% от стойността на портфейла.

Вземанията от хеджиране и от предплатени такси, възлизат на 0.57% от активите на Фонда.

На 29.05.2020 г. нетната стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик е 847 190 лв., а нетната стойност на активите на един дял е 7.6413 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 29.05.2020 г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ "Ди Ви Динамик" към 31.05.2020 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции	241 867	28.42%
Борсово Търгувани Фондове (Акции)	307 250	36.10%
В брой и разплащателни сметки	297 159	34.91%
Вземания*	4 848	0.57%
Общо активи	851 124	100.00%
* Вземания във връзка с предварително платени такси към КФН и вземания от хеджиране .		



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	25 932.150	1.0000	\$25 932.15
Валутно деноминиран актив	USD	350.000	114.120	\$39 942.00
Валутно деноминиран актив	USD	546.000	61.620	\$33 644.52
Обща рискова позиция				\$99 518.67

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 81 000.00	1.081980	\$87 640.38	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$87 640.38		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД