

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.

Към 31.12.2017г. 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 31.12.2017 г. възлиза на 29.14%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 49.19% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.12.2017г. са 19.06% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, вземанията от дивиденди и вземанията от хеджиране възлизат на 2.61% от активите на Фонда.

На 29.12.2017г. нетната стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик е 1 237 916 лв., а нетната стойност на активите на един дял е 8.3806 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

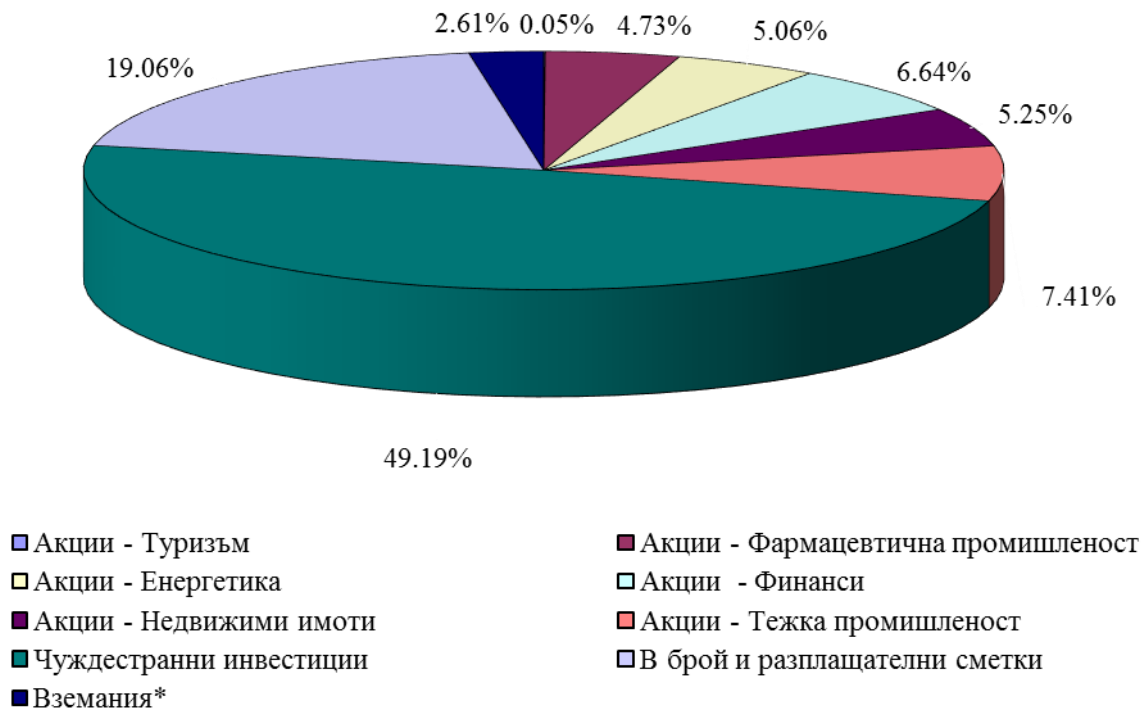
Структурата на портфейла на ДФ Ди Ви Динамик към 31.12.2017г. е представена в следната таблица и графика.



Структура на портфейла на ДФ "Ди Ви Динамик" към 31.12.2017 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Туризъм	635	0.05%
Акции - Фармацевтична промишленост	58 717	4.73%
Акции - Енергетика	62 872	5.06%
Акции - Финанси	82 566	6.64%
Акции - Недвижими имоти	65 210	5.25%
Акции и права - Тежка промишленост	92 120	7.41%
Чуждестранни инвестиции	611 223	49.19%
В брой и разплащателни сметки	236 871	19.06%
Вземания*	32 423	2.61%
Общо активи	1 242 637	100.00%

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

Разпределение на активите на Ди Ви Динамик към 31/12/2017



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	34 054.270	1.0000	\$34 054.27
Валутно деноминиран актив	USD	129.000	266.860	\$34 424.94
Валутно деноминиран актив	USD	337.000	155.760	\$52 491.12
Валутно деноминиран актив	USD	350.000	124.340	\$43 519.00
Валутно деноминиран актив	USD	837.000	52.780	\$44 176.86
Обща рискова позиция				\$208 666.19

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 100 000.00	1.188700	\$118 870.00	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 76 000.00	1.187065	\$90 216.94		
Обща хеджираща позиция				\$209 086.94		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД