



**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 продажбите на акции от български публични дружества, търгувани на БФБ – София АД.

Към 31.01.2016 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 31.01.2016 г. възлиза на 26.40%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 52.40% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Към 31.01.2016 г. корпоративните облигации представляват 3.28% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.01.2016 г. са 8.81% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии , вземания от хеджиране и вземане по договор възлизат на 9.11% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.01.2016 г. е минус 2.74% на годишна база*. Доходността от началото на годината е минус 4.20% , а доходността за последните 12 месеца към 29.01.2016 г. е минус 17.03%.

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 31.01.2016 г. е представена в следната таблица и графика.

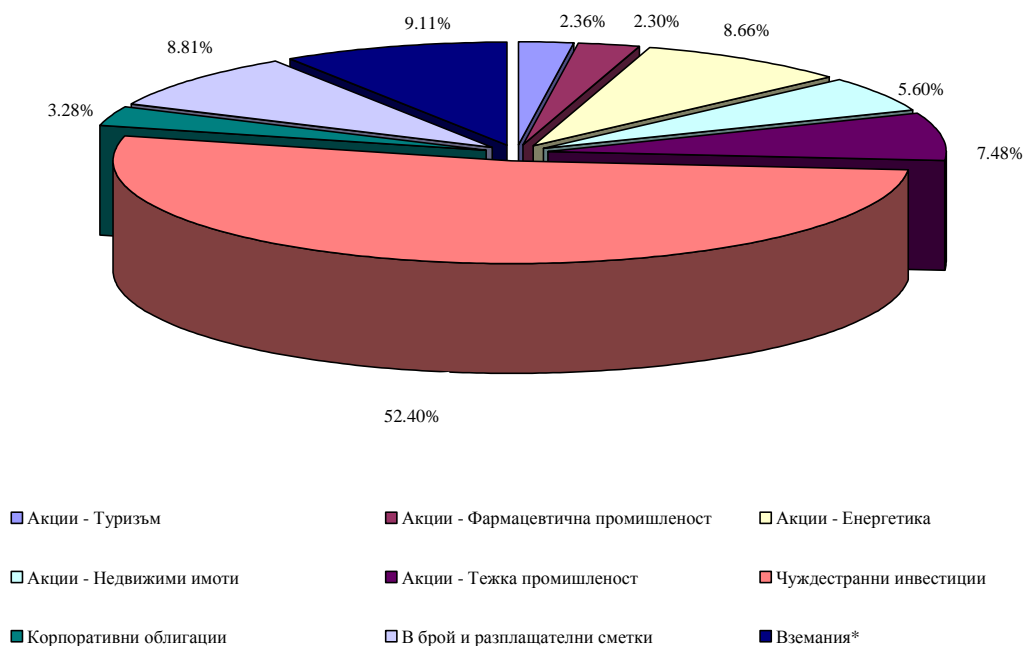
* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.



Структура на портфейла на ДФ "Ди Ви Динамик" към 31.01.2016 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Туризм	30 325	2.36%
Акции - Фармацевтична промишленост	29 584	2.30%
Акции - Енергетика	111 481	8.66%
Акции - Недвижими имоти	72 128	5.60%
Акции - Тежка промишленост	96 320	7.48%
Чуждестранни инвестиции	674 569	52.40%
Корпоративни облигации	42 300	3.28%
В брой и разплащателни сметки	113 373	8.81%
Вземания*	117 297	9.11%
Общо активи	1 287 377	100.00%

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

Разпределение на активите на Ди Ви Динамик към 31/01/2016





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	14 194.570	1.0000	\$14 194.57
Валутно деноминиран актив	USD	200.000	193.7208	\$38 744.16
Валутно деноминиран актив	USD	1 000.000	41.240	\$41 240.00
Валутно деноминиран актив	USD	570.000	104.130	\$59 354.10
Обща рискова позиция				\$153 532.83

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 90 000.00	1.088910	\$98 001.90	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 54 000.00	1.082280	\$58 443.12		
Обща хеджираща позиция				\$156 445.02		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД