



**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 чуждестранни инвестиции.

Към 31.07.2017г. 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 31.07.2017 г. възлиза на 27.80%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 48.38% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Към 31.07.2017г. корпоративните облигации представляват 0.94% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.07.2017г. са 18.45% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии , вземанията от хеджиране и вземанията от дивиденди възлизат на 4.43% от активите на Фонда.

На 31.07.2017г. нетната стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик е 1 294 723 лв., а нетната стойност на активите на един дял е 8.5712 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

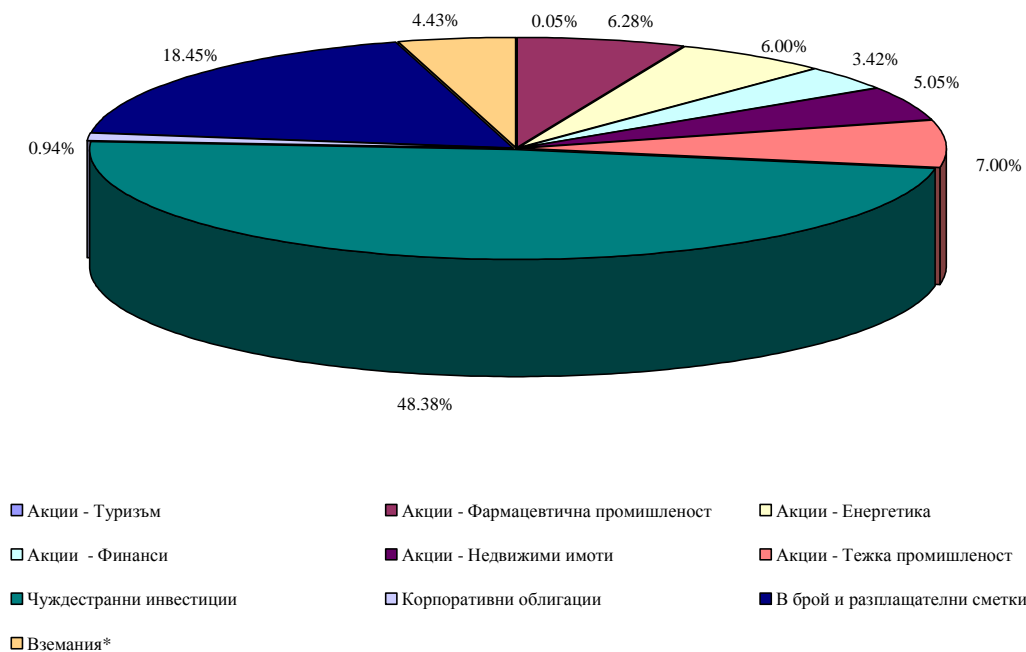
Структурата на портфейла на ДФ Ди Ви Динамик към 31.07.2017г. е представена в следната таблица и графика.



Структура на портфейла на ДФ "Ди Ви Динамик" към 31.07.2017 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Туризм	628	0.05%
Акции - Фармацевтична промишленост	81 492	6.28%
Акции - Енергетика	77 847	6.00%
Акции - Финанси	44 398	3.42%
Акции - Недвижими имоти	65 537	5.05%
Акции - Тежка промишленост	90 916	7.00%
Чуждестранни инвестиции	627 993	48.38%
Корпоративни облигации	12 235	0.94%
В брой и разплащателни сметки	239 513	18.45%
Вземания*	57 483	4.43%
Общо активи	1 298 042	100.00%

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

Разпределение на активите на Ди Ви Динамик към 31/07/2017





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	33 226.080	1.0000	\$33 226.08
Валутно деноминиран актив	USD	129.000	246.770	\$31 833.33
Валутно деноминиран актив	USD	337.000	143.230	\$48 268.51
Валутно деноминиран актив	USD	837.000	49.920	\$41 783.04
Валутно деноминиран актив	USD	350.000	117.200	\$41 020.00
Обща рискова позиция				\$196 130.96

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 100 000.00	1.166300	\$116 630.00	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 70 000.00	1.147150	\$80 300.50		
Обща хеджираща позиция				\$196 930.50		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД