

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. Продадени са и чуждестранни инвестиции.

Към 30.09.2017г. 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 30.09.2017 г. възлиза на 32.32%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 53.26% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Към 30.09.2017г. корпоративните облигации представляват 0.94% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.09.2017г. са 9.51% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии и вземанията от дивиденди възлизат на 3.97% от активите на Фонда.

На 29.09.2017г. нетната стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик е 1 295 365 лв., а нетната стойност на активите на един дял е 8.6574 лв.

I. Данни по чл. 72, ал. 2 от Наредба № 44

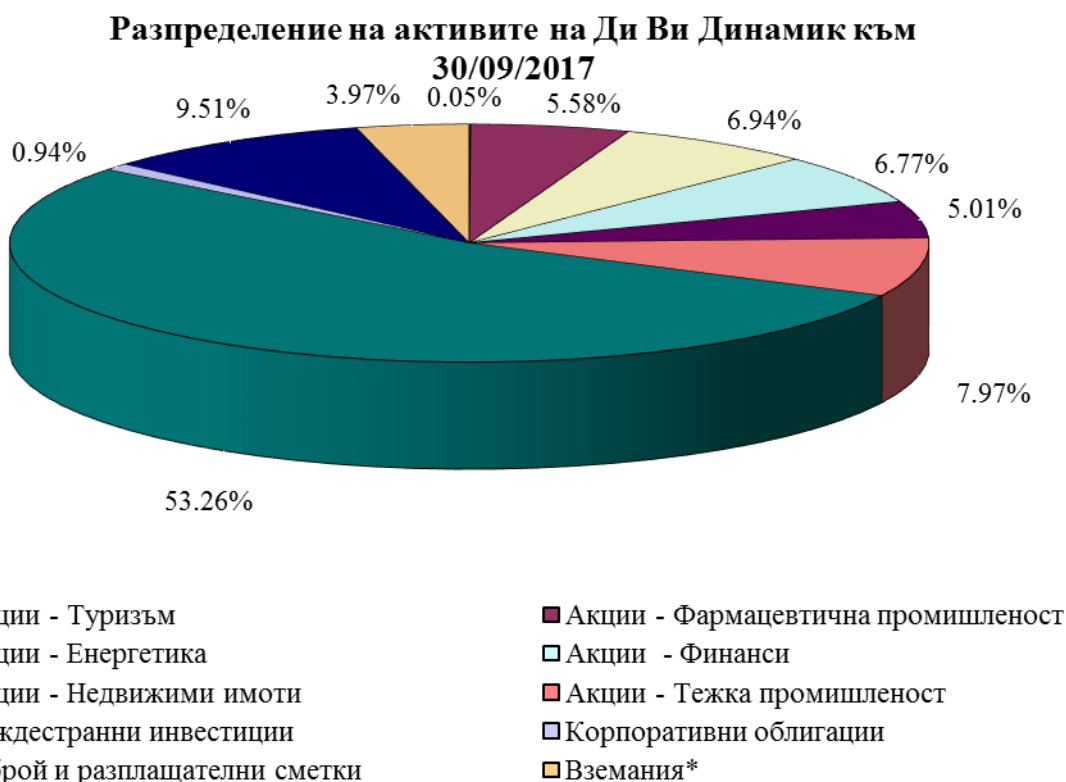
1. Данни по чл. 72, ал. 2, т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти

Структурата на портфейла на ДФ Ди Ви Динамик към 30.09.2017г. е представена в следната таблица и графика.



Структура на портфейла на ДФ "Ди Ви Динамик" към 30.09.2017 г.		
Акции - Туризм	630	0.05%
Акции - Фармацевтична промишленост	72 738	5.58%
Акции - Енергетика	90 388	6.94%
Акции - Финанси	88 162	6.77%
Акции - Недвижими имоти	65 216	5.01%
Акции - Тежка промишленост	103 823	7.97%
Чуждестранни инвестиции	693 768	53.26%
Корпоративни облигации	12 308	0.94%
В брой и разплащателни сметки	123 898	9.51%
Вземания*	51 672	3.97%
Общо активи	1 302 603	100.00%

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



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	33 506.210	1.0000	\$33 506.21
Валутно деноминиран актив	USD	129.000	251.230	\$32 408.67
Валутно деноминиран актив	USD	337.000	145.450	\$49 016.65
Валутно деноминиран актив	USD	837.000	50.340	\$42 134.58
Валутно деноминиран актив	USD	350.000	118.510	\$41 478.50
Обща рискова позиция				\$198 544.61

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 100 000.00	1.193120	\$119 312.00	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 70 000.00	1.190900	\$83 363.00		
Обща хеджираща позиция				\$202 675.00		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД