

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

Към 31.12.2015г. 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 31.12.2015г. възлиза на 27.13%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 53.55% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Към 31.12.2015г. корпоративните облигации представляват 3.11% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.12.2015г. са 7.60% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии , вземания от дивиденди и вземане по договор възлизат на 8.61% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.12.2015г. е минус 2.36% на годишна база\*. Доходността от началото на годината и доходността за последните 12 месеца към 30.12.2015г. е минус 12.89%.

**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 31.12.2015г. е представена в следната таблица и графика.

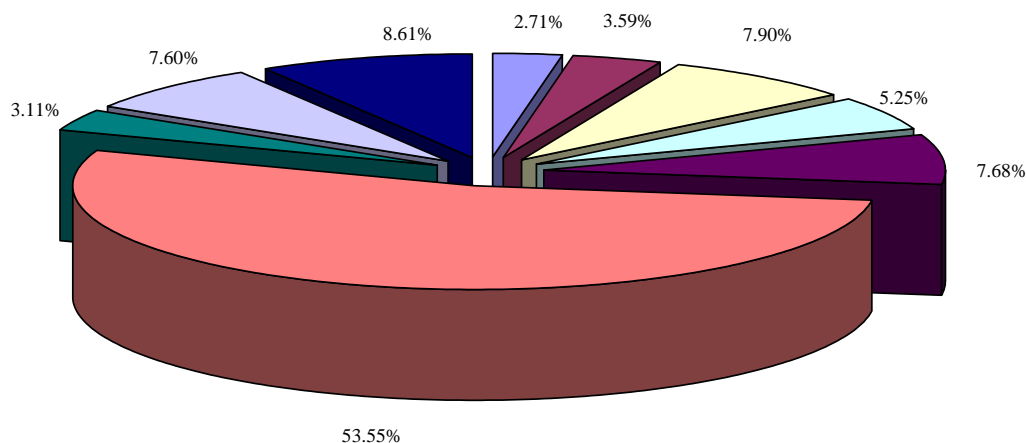
\* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.



Структура на портфейла на ДФ "Ди Ви Динамик" към 31.12.2015 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Туризъм	36 585	2.71%
Акции - Фармацевтична промишленост	48 537	3.59%
Акции - Енергетика	106 843	7.90%
Акции - Недвижими имоти	70 915	5.25%
Акции - Тежка промишленост	103 828	7.68%
Чуждестранни инвестиции	723 953	53.55%
Корпоративни облигации	42 040	3.11%
В брой и разплащателни сметки	102 757	7.60%
Вземания*	116 324	8.61%
Общо активи	1 351 782	100.00%

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

Разпределение на активите на Ди Ви Динамик към 31/12/2015



- Акции - Туризъм
- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Енергетика
- Акции - Недвижими имоти
- Акции - Тежка промишленост
- Чуждестранни инвестиции
- Корпоративни облигации
- В брой и разплащателни сметки
- Вземания\*

**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.

<b>Рисков актив</b>				
<b>ISIN</b>	<b>Валута</b>	<b>Брой</b>	<b>Цена</b>	<b>Обща Стойност</b>
Валутно деноминиран актив	USD	13 707.280	1.0000	\$13 707.28
Валутно деноминиран актив	USD	200.000	205.930	\$41 186.00
Валутно деноминиран актив	USD	1 000.000	42.260	\$42 260.00
Валутно деноминиран актив	USD	570.000	113.270	\$64 563.90
<b>Обща рискова позиция</b>				\$161 717.18

<b>Деривативен инструмент</b>						
<b>Вид</b>	<b>Валута</b>	<b>Брой</b>	<b>Цена</b>	<b>Обща Стойност</b>	<b>Пазар</b>	<b>Държава</b>
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 90 000.00	1.096280	\$98 665.20	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 54 000.00	1.096090	\$59 188.86		
<b>Обща хеджираща позиция</b>				\$157 854.06		

Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД