



**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 и продажбите на акции от български публични дружества, търгувани на БФБ – София АД. Закупени са и са продадени и чуждестранни инвестиции.

Към 31.08.2016 г. 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 31.08.2016 г. възлиза на 26.44%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 58.71% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Към 31.08.2016 г. корпоративните облигации представляват 0.78% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.08.2016 г. са 8.58% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии и вземане от дивиденди възлизат на 5.49% от активите на Фонда.

На 31.08.2016 г. нетната стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик е 1 188 183 лв., а нетната стойност на активите на един дял е 7.1693 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

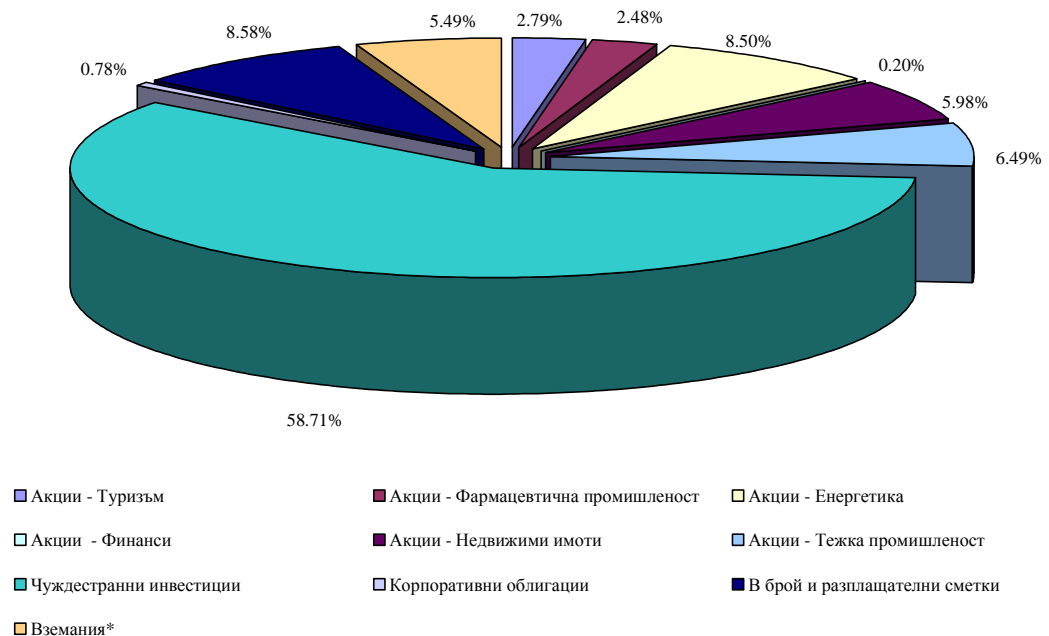
Структурата на портфейла на ДФ Ди Ви Динамик към 31.08.2016 г. е представена в следната таблица и графика.



Структура на портфейла на ДФ "Ди Ви Динамик" към 31.08.2016 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Туризъм	33 416	2.79%
Акции - Фармацевтична промишленост	29 660	2.48%
Акции - Енергетика	101 695	8.50%
Акции - Финанси	2 338	0.20%
Акции - Недвижими имоти	71 572	5.98%
Акции - Тежка промишленост	77 648	6.49%
Чуждестранни инвестиции	702 247	58.71%
Корпоративни облигации	9 278	0.78%
В брой и разплащателни сметки	102 588	8.58%
Вземания*	65 630	5.49%
Общо активи	1 196 072	100.00%

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

Разпределение на активите на Ди Ви Динамик към 31/08/2016





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	2 092.820	1.0000	\$2 092.82
Валутно деноминиран актив	USD	1 000.000	45.970	\$45 970.00
Валутно деноминиран актив	USD	337.000	116.440	\$39 240.28
Валутно деноминиран актив	USD	1 405.000	39.170	\$55 033.85
Валутно деноминиран актив	USD	200.000	217.3800	\$43 476.00
Обща рискова позиция				\$185 812.95

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 100 000.00	1.115370	\$111 537.00	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 68 000.00	1.130690	\$76 886.92		
Обща хеджираща позиция				\$188 423.92		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД