



**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 чуждестранни инвестиции.

Към 31.05.2017г. 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 31.05.2017 г. възлиза на 30.50%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 47.67% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Към 31.05.2017г. корпоративните облигации представляват 0.89% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.05.2017г. са 16.98% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии , вземанията от хеджиране и от авансово платена сума за одит възлизат на 3.96% от активите на Фонда.

На 31.05.2017г. нетната стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик е 1 276 328 лв., а нетната стойност на активите на един дял е 8.4052 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 31.05.2017г. е представена в следната таблица и графика.

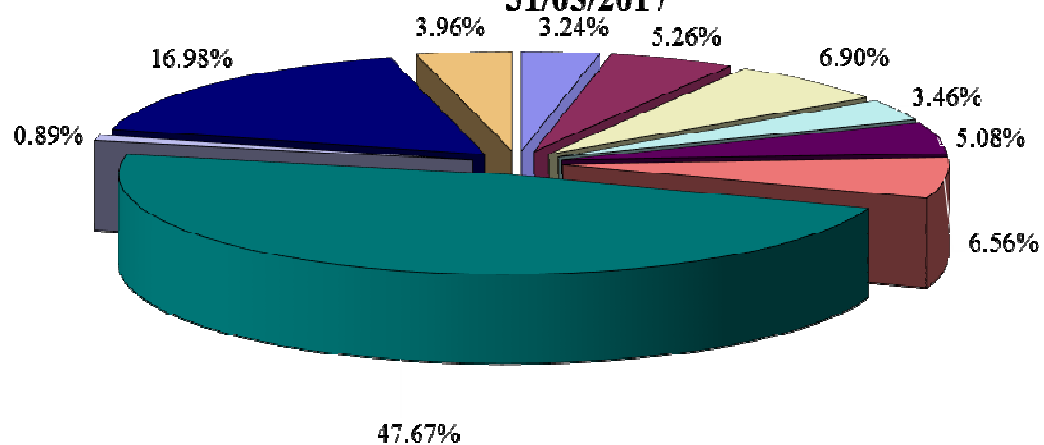
Вземания във връзка с главница и лихва по облигационни емисии и вземания от хеджиране.



Структура на портфейла на ДФ "Ди Ви Динамик" към 31.05.2017 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Туризъм	41 424	3.24%
Акции - Фармацевтична промишленост	67 308	5.26%
Акции - Енергетика	88 229	6.90%
Акции - Финанси	44 304	3.46%
Акции - Недвижими имоти	64 996	5.08%
Акции - Тежка промишленост	83 966	6.56%
Чуждестранни инвестиции	609 935	47.67%
Корпоративни облигации	11 412	0.89%
В брой и разплащателни сметки	217 235	16.98%
Вземания*	50 716	3.96%
Общо активи	1 279 525	100.00%

\* Вземания във връзка с главница и лихва по облигационни емисии, вземания от хеджиране и от авансово платена сума за одит.

**Разпределение на активите на Ди Ви Динамик към  
31/05/2017**



- Акции - Туризъм
- Акции - Енергетика
- Акции - Недвижими имоти
- Чуждестранни инвестиции
- В брой и разплащателни сметки
- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Финанси
- Акции - Тежка промишленост
- Корпоративни облигации
- 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	32 713.050	1.0000	\$32 713.05
Валутно деноминиран актив	USD	129.000	241.440	\$31 145.76
Валутно деноминиран актив	USD	337.000	141.290	\$47 614.73
Валутно деноминиран актив	USD	837.000	49.360	\$41 314.32
Валутно деноминиран актив	USD	350.000	114.530	\$40 085.50
<b>Обща рискова позиция</b>				<b>\$192 873.36</b>

<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	€ 100 000.00	1.124700	\$112 470.00	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 77 000.00	1.111110	\$85 555.47		
<b>Обща хеджираща позиция</b>				<b>\$198 025.47</b>		

Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД