

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 няма продажби на акции.

Към 31.05.2019 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 31.05.2019 г. възлиза на 34.45%.

Делът на борсово търгуваните фондове (Акции) е 58.33% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.05.2019 г. са 6.08% от стойността на портфейла.

Вземанията от хеджиране, вземанията от дивиденди, както и други вземания възлизат на 1.14% от активите на Фонда.

На 31.05.2019 г. нетната стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик е 1 042 614 лв., а нетната стойност на активите на един дял е 7.6642 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 31.05.2019 г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ "Ди Ви Динамик" към 31.05.2019 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции	360 855	34.45%
Борсово Търгувани Фондове (Акции)	611 050	58.33%
В брой и разплащателни сметки	63 716	6.08%
Вземания*	11 931	1.14%
Общо активи	1 047 552	100.00%

* Вземания във връзка с начислени дивиденди, лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, предварително платени такси към КФН, вземания от хеджиране и др.



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	18 493.980	1.0000	\$18 493.98
Валутно деноминиран актив	USD	129.000	275.270	\$35 509.83
Валутно деноминиран актив	USD	241.000	173.950	\$41 921.95
Валутно деноминиран актив	USD	350.000	119.570	\$41 849.50
Валутно деноминиран актив	USD	546.000	59.110	\$32 274.06
Обща рискова позиция				\$170 049.32

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 64 000.00	1.123500	\$71 904.00	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 92 000.00	1.121400	\$103 168.80	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$175 072.80		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД