

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 има продажба на права, търгувани на БФБ – София АД.

Към 31.01.2018г. 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 31.01.2018 г. възлиза на 29.58%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 48.70% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.01.2018г. са 18.95% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, вземанията от продажби на права и вземанията от хеджиране възлизат на 2.77% от активите на Фонда.

На 31.01.2018г. нетната стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик е 1 270 611 лв., а нетната стойност на активите на един дял е 8.6028 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

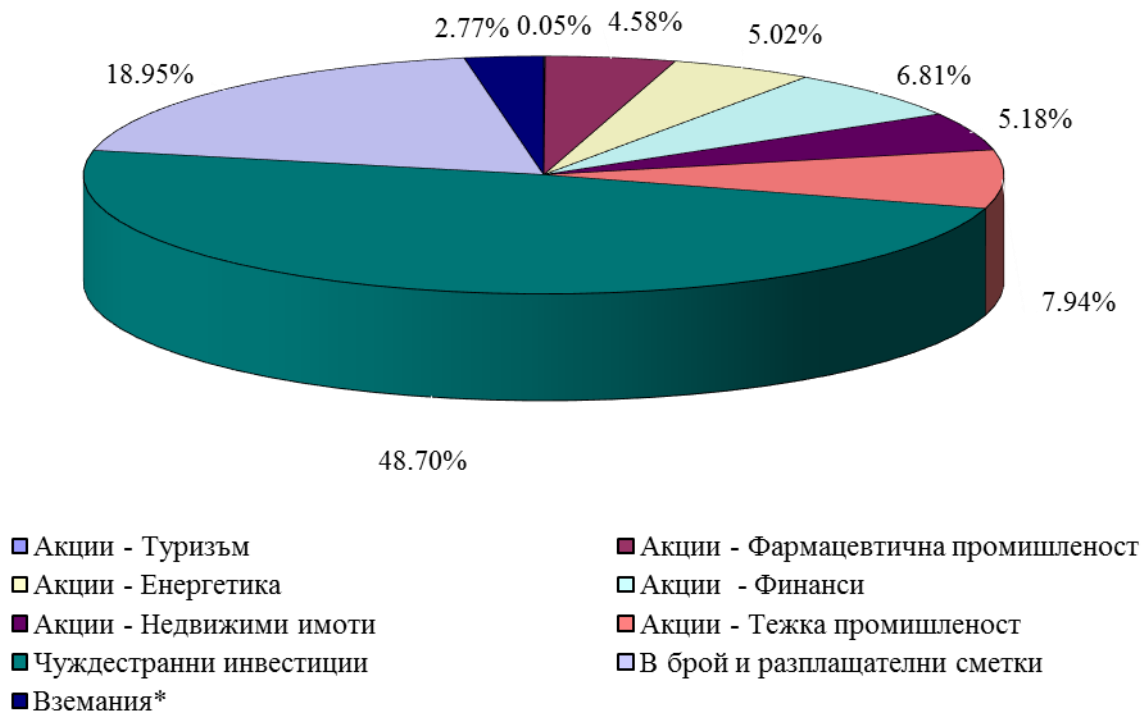
Структурата на портфейла на ДФ Ди Ви Динамик към 31.01.2018г. е представена в следната таблица и графика.



Структура на портфейла на ДФ "Ди Ви Динамик" към 31.01.2018 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Туризъм	630	0.05%
Акции - Фармацевтична промишленост	58 388	4.58%
Акции - Енергетика	64 032	5.02%
Акции - Финанси	86 952	6.81%
Акции - Недвижими имоти	66 106	5.18%
Акции - Тежка промишленост	101 281	7.94%
Чуждестранни инвестиции	621 315	48.70%
В брой и разплащателни сметки	241 761	18.95%
Вземания*	35 344	2.77%
Общо активи	1 275 809	100.00%

* Вземания за главница и лихва по облигационна емисия, вземания от продажба на права и вземания от хеджиране.

Разпределение на активите на Ди Ви Динамик към 31/01/2018



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	34 169.050	1.0000	\$34 169.05
Валутно деноминиран актив	USD	129.000	281.900	\$36 365.10
Валутно деноминиран актив	USD	337.000	169.400	\$57 087.80
Валутно деноминиран актив	USD	350.000	129.040	\$45 164.00
Валутно деноминиран актив	USD	837.000	54.620	\$45 716.94
Обща рискова позиция				\$218 502.89

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 100 000.00	1.225800	\$122 580.00	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 76 000.00	1.223200	\$92 963.20		
Обща хеджираща позиция				\$215 543.20		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД