



**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.

Към 31.10.2016 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 31.10.2016 г. възлиза на 31.71%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 56.82% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Към 31.10.2016 г. корпоративните облигации представляват 0.83% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.10.2016 г. са 5.29% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии и вземане от хеджиране възлизат на 5.35% от активите на Фонда.

На 31.10.2016 г. нетната стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик е 1 183 550 лв., а нетната стойност на активите на един дял е 7.2861 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 31.10.2016 г. е представена в следната таблица и графика.

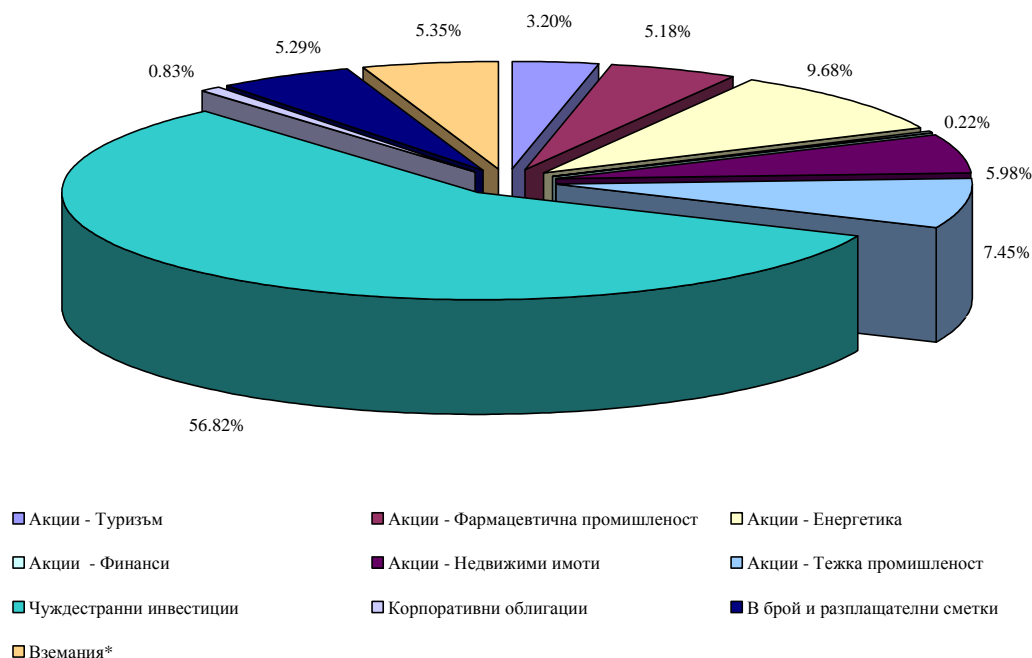


Структура на портфейла на ДФ "Ди Ви Динамик" към 31.10.2016 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Туризъм	37 955	3.20%
Акции - Фармацевтична промишленост	61 503	5.18%
Акции - Енергетика	115 031	9.68%
Акции - Финанси	2 580	0.22%
Акции - Недвижими имоти	70 995	5.98%
Акции - Тежка промишленост	88 445	7.45%
Чуждестранни инвестиции	674 788	56.82%
Корпоративни облигации	9 909	0.83%
В брой и разплащателни сметки	62 863	5.29%
Вземания*	63 574	5.35%
Общо активи	1 187 643	100.00%

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



Разпределение на активите на Ди Ви Динамик към 31/10/2016



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	707.000	1.0000	\$707.00
Валутно деноминиран актив	USD	1 000.000	44.180	\$44 180.00
Валутно деноминиран актив	USD	337.000	116.990	\$39 425.63
Валутно деноминиран актив	USD	1 405.000	37.710	\$52 982.55
Валутно деноминиран актив	USD	200.000	212.5500	\$42 510.00
Обща рискова позиция				\$179 805.18

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 100 000.00	1.092440	\$109 244.00	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 68 000.00	1.088720	\$74 032.96		
Обща хеджираща позиция				\$183 276.96		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД