

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 месец Декември няма покупки и продажби на акции и борсово търгувани фондове (акции).

Към 31.12.2019 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 31.12.2019 г. възлиза на 29.98%.

Делът на борсово търгуваните фондове (Акции) е 50.33% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.12.2019 г. са 16.43% от стойността на портфейла.

Вземанията по договор за цесия, начислени дивиденди и вземания от хеджиране, възлизат на 3.26% от активите на Фонда.

На 31.12.2019 г. нетната стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик е 936 059 лв., а нетната стойност на активите на един дял е 8.3542 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 31.12.2019 г. е представена в следната таблица и графика.

| Структура на портфейла на ДФ "Ди Ви Динамик" към 31.12.2019 г. | | |
|---|------------------------|----------------------------|
| Актив | Стойност в лева | Процент от активите |
| Акции | 290 719 | 29.98% |
| Борсово Търгувани Фондове (Акции) | 487 868 | 50.33% |
| В брой и разплащателни сметки | 159 235 | 16.43% |
| Вземания* | 31 636 | 3.26% |
| Общо активи | 969 458 | 100.00% |

* Вземания по договор за цесия , начислени дивиденди и вземания от хеджиране.



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 | 59 012.610 | 1.0000 | \$59 012.61 |
| Валутно деноминиран актив | USD | 241.000 | 212.610 | \$51 239.01 |
| Валутно деноминиран актив | USD | 350.000 | 136.480 | \$47 768.00 |
| Валутно деноминиран актив | USD | 546.000 | 65.600 | \$35 817.60 |
| Обща рискова позиция | | | | \$193 837.22 |

| Деривативен инструмент | | | | | | |
|-------------------------------|---------------|-------------|-------------|----------------------|--------------|----------------|
| Вид | Валута | Брой | Цена | Обща Стойност | Пазар | Държава |
| Форуърд купува EUR/USD | EUR/USD | € 64 000.00 | 1.116500 | \$71 456.00 | OTC | България |
| Форуърд купува EUR/USD | EUR/USD | € 92 000.00 | 1.116000 | \$102 672.00 | OTC | България |
| Обща хеджираща позиция | | | | \$174 128.00 | | |

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД