



**ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО
ЧЛ. 73 (1) Т.5 ОТ НАРЕДБА № 44 ЗА ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА
КИС, УД, НАЦИОНАЛНИТЕ ИНВЕСТИЦИОННИ ФОНДОВЕ И ЛИЦАТА,
УПРАВЛЯВАЩИ АЛТЕРНАТИВНИ ИНВЕСТИЦИОННИ
ФОНДОВЕ**

ДОГОВОРЕН ФОНД „ДИ ВИ ДИНАМИК”

I. Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5 от Наредба № 44, във връзка с чл.75, т.2

1) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5, б. „г”: Промени в структурата на портфейла през отчетния период

Съгласно инвестиционната политика и стратегия на Фонда за инвестиране предимно в акции, търгувани на регулираните пазари в страната и чужбина, през периода продължават покупките и продажбите на акции от български публични дружества, търгувани на БФБ. Закупени са и са продадени чуждестранни инвестиции.

Към 30.06.2018г. 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 30.06.2018 г. възлиза на 35.59%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 54.47% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.06.2018г. са 7.11% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, вземанията от хеджиране и вземанията от дивиденди възлизат на 2.83% от активите на Фонда.

На 29.06.2018г. нетната стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик е 1,161,358 лв., а нетната стойност на активите на един дял е 8.0908 лв.

2) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б. „а” и „д”: Промени в състоянието на активите в рамките на отчетния период

Долната таблица представя приходите на Фонда към 30.06.2018г. Приходите са в размер на 607,283 лв., включващи приходи от операции с финансови активи, положителни курсови разлики и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лева		
	30/06/17	31/12/17	30/06/18
Приходи от лихви	1,403	1,718	-
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	439,119	854,875	436,386
Положителни курсови разлики	167,985	338,582	160,405
Други финансови приходи	9,688	41,253	10,492
Общо приходи:	618,195	1,236,428	607,283



Разходите на Фонда за отчетния период са представени в таблицата по-долу:

Разходи	Стойност в лева		
	30/06/17	31/12/17	30/06/18
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	297,067	739,277	467,833
Отрицателни курсови разлики	169,806	344,476	164,892
Разходи за външни услуги	14,804	29,807	15,509
Други финансови разходи	1,031	1,949	1,378
Общо разходи:	482,708	1,115,509	649,612

Общият размер на разходите на фонда към 30.06.2018г. е 649,612 лева, които включват 467,833 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти, 164,892 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове, както и разходи за външни услуги и други финансови разходи в размер на 16,887 лева, които са представени подробно по-долу:

а) Възнаграждение на управляващото дружество
- към 30.06.2018г. – 10,851 лв.
- като процент от средната нетна стойност на активите за отчетния период: 0.90%

б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество
- към 30.06.2018г. – 281 лв.
- като процент от средната нетна стойност на активите за отчетния период: 0.02%

в) Възнаграждение на банката депозитар
- към 30.06.2018г. – 2,001 лв.
- като процент от средната нетна стойност на активите за отчетния период: 0.17%

г) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие
- към 30.06.2018г. – 1,800 лв.
- като процент от средната нетна стойност на активите за отчетния период: 0.15%

д) Други разходи
- към 30.06.2018г. – 1,954 лв.
- като процент от средната нетна стойност на активите за отчетния период: 0.16%

- Други разходи по финансови операции: 1,097 лв.
- Външни услуги (КФН, ЦД и други услуги): 857 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 16,887 лв. към месец юни 2018. Като процент от средната нетна стойност на активите за отчетния период тези разходи са: 1.40%.

	Стойност в лева		
	30/06/17	31/12/17	30/06/18
Общо Приходи	618,195	1,236,428	607,283
Общо Разходи	482,708	1,115,509	649,612
Нетен Резултат	135,487	120,919	(42,329)

За периода няма записани дялове, а са изкупени обратно 4,171.8503 броя дялове. НСА на фонда към 30.06.2017г. е 1,281,266 лв., към 31.12.2017 г. е 1,237,916 лв., а към 30.06.2018г. е 1,161,358 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 143,539.8243.

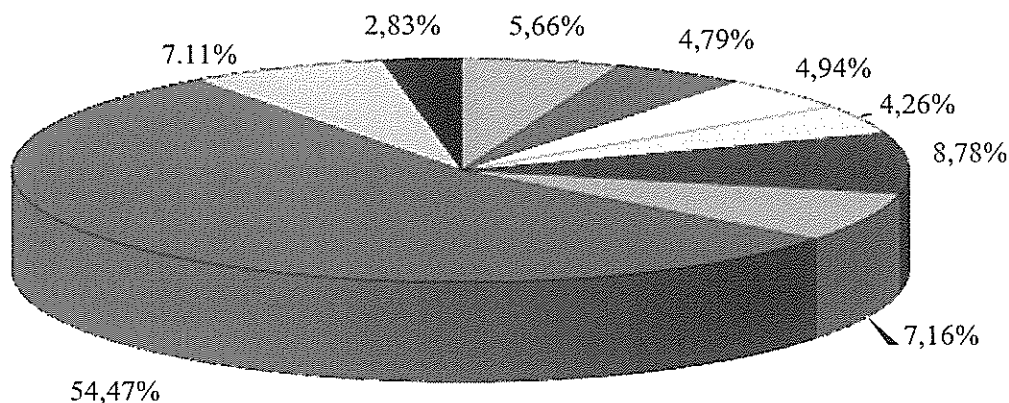
3) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б. „в” и „г”: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

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

Структура на портфейла на ДФ „Ди Ви Динамик“					
Актив	Стойност в лева 31.12.2017	Процент от активите 31.12.2017	Стойност в лева 30.06.2018	Процент от активите 30.06.2018	Валута (EUR, USD, BGN)
Акции - Туризм	635	0.05%	-	0.00%	BGN
Акции - Холдинги	-	0.00%	65,900	5.66%	BGN
Акции - Фармацевтична промишленост	58,717	4.73%	55,783	4.79%	BGN
Акции - Финанси	82,566	6.64%	49,578	4.26%	BGN
Акции-Тежка промишленост	92,120	7.41%	83,396	7.16%	BGN
Акции - Недвижими имоти	65,210	5.25%	102,206	8.78%	BGN
Акции - Енергетика	62,872	5.06%	57,536	4.94%	BGN
Чуждестранни инвестиции	611,223	49.19%	634,275	54.47%	USD, EUR
В брой и по разплащателни сметки	236,871	19.06%	82,708	7.11%	BGN, EUR, USD
Вземания*	32,423	2.61%	32,980	2.83%	BGN
Общо активи	1,242,637	100.00%	1,164,362	100.00%	EUR, USD, BGN

* Вземания за главница и лихва по облигационни емисии, вземания във връзка с начислени дивиденди и вземания от хеджиране.

Разпределение на активите на Ди Ви Динамик към 30/06/2018

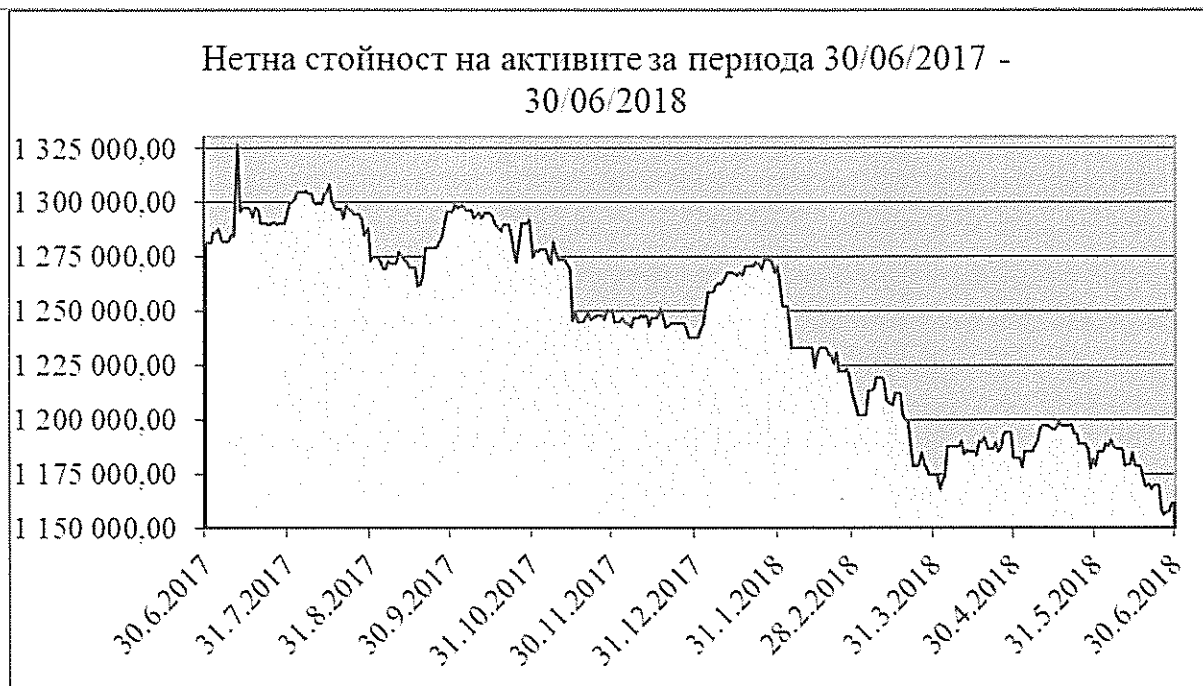


- Акции - Холдинги
- Акции - Енергетика
- Акции - Недвижими имоти
- Чуждестранни инвестиции
- Вземания*
- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Финанси
- Акции - Тежка промишленост
- В брой и разплащателни сметки

4) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б. „б“: Нетна стойност на активите на един дял

Към 30.06.2017 г. нетна стойност на активите на един дял е 8.4821 лв. На 31.12.2017 г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 8.3806 лв. Към 30.06.2018 г. нетната стойност на активите на един дял е 8.0908 лв.

Изменението на нетната стойност на активите на Фонда е представено на следващата графика.



5) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5, б. „е“: Сравнителна таблица за последните три периода, включваща общата стойност на нетните активи и нетна стойност на един дял

	30/06/2017 (лв)	31/12/2017 (лв)	30/06/2018 (лв)
Нетна стойност на активите на „Ди Ви Динамик“	1,281,266	1,237,916	1,161,358
Нетна стойност на активите на един дял	8.4821	8.3806	8.0908

6) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5, б. „ж“: задължения, възникнали от сделки 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	15633.4200	1.000	\$15 633.42
Валутно деноминиран актив	USD	129.000	271.280	\$34 995.12
Валутно деноминиран актив	USD	337.000	171.650	\$57 846.05
Валутно деноминиран актив	USD	350.000	121.380	\$42 483.00
Валутно деноминиран актив	USD	546.000	53.160	\$29 025.36
Обща рискова позиция				\$179 982.95

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 67 000.00	1.160700	\$77 766.90	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 92 000.00	1.158700	\$106 600.40	OTC	България
Обща хеджираща позиция						\$184 367.30

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

