

**ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО
ЧЛ. 73(1) Т.5 ОТ НАРЕДБА № 44 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА
КОЛЕКТИВНИТЕ ИНВЕСТИЦИОННИ СХЕМИ, ИНВЕСТИЦИОННИТЕ
ДРУЖЕСТВА ОТ ЗАТВОРЕН ТИП И УПРАВЛЯВАЩИТЕ ДРУЖЕСТВА**

ДОГОВОРЕН ФОНД „ДИ ВИ ДИНАМИК”

I. Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5 от Наредба № 44

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 – София АД.

Към 31.12.2015г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ди Ви Динамик са разпределени в 5 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 31.12.2015г. възлиза на 27.13%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 53.55% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Към 31.12.2015г. корпоративните облигации представляват 3.11% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.12.2015г. са 7.60% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, вземания от дивиденди и вземане по договор възлизат на 8.61% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.12.2015г. е минус 2.36% на годишна база. Доходността за последните 12 месеца към 31.12.2015г. е минус 12.89%.

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 31.12.2015 г. Приходите са в размер на 1,530,528 лв., включващи приходи от операции с финансови активи, приходи от лихви, положителни курсови разлики и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лева	
	30.06.2015	31.12.2015
Приходи от лихви	3,301	5,831
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	506,965	1,125,999
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	201,215	375,686
Други финансови приходи	13,957	23,012
Общо приходи	725,438	1,530,528

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

Разходи	Стойност в лева	
	30.06.2015	31.12.2015
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	558,149	1,241,266
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	197,177	373,220
Други разходи	8,763	89,169
Разходи за външни услуги	19,421	35,638
Общо разходи	783,510	1,739,293

Общият размер на разходите на Фонда към 31.12.2015 г. е 1,739,293 лева, които включват 1,241,266 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 373,220 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове, както и разходи за външни услуги и други разходи общо в размер на 124,807 лева, които са представени подробно по-долу.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 31.12.2015 г. – 28,107 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.80%

б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество

- към 31.12.2015 г. – 161 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.01%

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 31.12.2015 г. – 2,400 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.15%

г) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие

- към 31.12.2015г. – 3,552 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.23%

д) Други разходи

- към 31.12.2015 г. – 90,587 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 5.79%

Други разходи по финансови операции: 89,008 лв.

Външни услуги (КФН, БФБ, ЦД и други услуги): 1,579 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 124,807 лв. към 31.12.2015 г. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 7.98%.

	Стойност в лева	
	30.06.2015	31.12.2015
Общо приходи	725,438	1,530,528
Общо разходи	783,510	1,739,293
Нетен резултат	(58,072)	(208,765)

За периода са емитирани 1,339.3146 дяла, а обратно са изкупени 18,577.1354 броя дялове. НСА на Фонда към 31.12.2014 г. е 1,698,527 лв., а към 31.12.2015 г. е 1,344,447 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 171,593.0837.

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” в края на периода е представена в следната таблица и графика:

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик					
Актив	Стойност в лева 31.12.2014	Процент от активите 31.12.2014	Стойност в лева 31.12.2015	Процент от активите 31.12.2015	Валута
					(EUR, USD, BGN)
Акции - Туризм	39,931	2.33%	36,585	2.71%	BGN
Акции - Фармацевтична промишленост	146,691	8.58%	48,537	3.59%	BGN
Акции - Енергетика	115,450	6.75%	106,843	7.90%	BGN
Акции - Недвижими имоти	94,788	5.54%	70,915	5.25%	BGN
Акции - Тежка промишленост	108,094	6.32%	103,828	7.68%	BGN
Чуждестранни инвестиции	560,289	32.76%	723,953	53.55%	USD, EUR
Корпоративни облигации	85,415	4.99%	42,040	3.11%	EUR
В брой и разплащателни сметки	153,741	8.99%	102,757	7.60%	EUR, USD, BGN
Вземания*	405,965	23.74%	116,324	8.61%	EUR, USD, BGN
Общо активи	1,710,364	100.00%	1,351,782	100.00%	EUR, USD, BGN

* Вземания във връзка с начислени дивиденди, лихвено и главнично плащане по облигационни емисии, вземания по договор и др.



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

На 31.12.2014 г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 8.9950 лв. На 30.06.2015 г. нетната стойност на активите на един дял е в размер на 8.6828 лв. Към 31.12.2015 г. нетната стойност на активите на един дял е 7.8351 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 финансови години, включваща общата стойност на нетните активи и нетна стойност на един дял

	Към 31 декември 2013 в лева	Към 31 декември 2014 в лева	Към 31 декември 2015 в лева
Нетна стойност на активите	1,913,054	1,698,527	1,344,447
Нетна стойност на активите на един дял	8.9848	8.9950	7.8351

б) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5, б. „ж“: задължения, възникнали от сделки с деривативни инструменти

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	13,707.28	1.0000	\$13,707.28
Валутно деноминиран актив	USD	200.00	205.930	\$41,186.00
Валутно деноминиран актив	USD	1,000.00	42.260	\$42,260.00
Валутно деноминиран актив	USD	570.00	113.270	\$64,563.90
Обща рискова позиция				\$161,717.18

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 90,000.00	1.096280	\$98,665.20	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 54,000.00	1.096090	\$59,188.86		
Обща хеджираща позиция				\$157,854.06		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД



Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД


