



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

ДОГОВОРЕН ФОНД „ДИ ВИ ХАРМОНИЯ”

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 и облигации, 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, както и на чуждестранни инвестиции. През периода са падежирали общински облигации.

Към 30.06.2017г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ди Ви Хармония са разпределени в 5 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 30.06.2017 г. възлиза на 16.05%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 45.51% от активите на ДФ Ди Ви Хармония.

Към 30.06.2017г. корпоративните облигации представляват 1.87% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Хармония.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.06.2017 г. са 15.69% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, вземанията от хеджиране и вземания от дивиденди възлизат на 20.88% от активите на Фонда.

На 30.06.2017г. нетната стойност на активите на ДФ Ди Ви Хармония е 1,073,034 лв., а нетната стойност на активите на един дял е 9.5179 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 30.06.2017 г. Приходите са в размер на 365,318 лв., включващи приходи от операции с финансови активи, приходи от лихви, положителни курсови разлики и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лв.		
	30.06.2016	31.12.2016	30.06.2017
Приходи от лихви	4,268	6,539	1,727
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	140,424	347,296	206,783
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	89,753	268,036	148,692
Други приходи от финансови операции	3,396	11,156	8,116
Общо приходи:	237,841	633,027	365,318

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

Разходи	Стойност в лв.		
	30.06.2016	31.12.2016	30.06.2017
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	163,003	388,480	180,569
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	91,238	276,648	151,281
Други финансови разходи	39,644	40,963	1,032
Разходи за външни услуги	4,314	7,983	3,562
Общо разходи:	298,199	714,074	336,444

Общият размер на разходите на Фонда към 30.06.2017 г. е 336,444 лв. които включват 180,569 лв. разходи от операции с финансови активи и инструменти 151,281 лв. отрицателни разлики от промяна на валутни курсове.

а) Възнаграждение на управляващото дружество
- към 30.06.2017 г. – 0 лв.
- като процент от средната нетна стойност на активите за отчетния период: 0.00%

б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания дадени от управляващото дружество
- към 30.06.2017 г. – 14 лв.
- като процент от средната нетна стойност на активите за отчетния период: 0.001%

в) Възнаграждение на банката депозитар
- към 30.06.2017 г – 1,200 лв.
- като процент от средната нетна стойност на активите за отчетния период: 0.11%



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

- към 30.06.2017 г. – 1,800 лв.

- като процент от средната нетна стойност на активите за отчетния период: 0.17%.

д) Други разходи

- към към 30.06.2017 г – 1,580 лв.

- като процент от средната нетна стойност на активите за отчетния период: 0.14%

- Други разходи по финансови операции: 1,018 лв.

- Външни услуги (КФН ЦД и други услуги): 562 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 4,594 лв. към месец юни; като процент от средната нетна стойност на активите за отчетния период тези разходи са: 0.43%.

	Стойност в лева		
	30/06/2016	31/12/2016	30/06/2017
Общо Приходи	237,841	633,027	365,318
Общо Разходи	298,199	714,074	336,444
Нетен Резултат	(60,358)	(81,047)	28,874

За периода са записани 104.9373 броя дялове и обратно са изкупени 121.7132 броя дялове. НСА на фонда към 30.06.2016 г. е 1,076,489лв. към 31.12.2016 г. е 1,044,313 лв. а към 30.06.2017 г.- 1,073,034 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 112 738.4708.

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

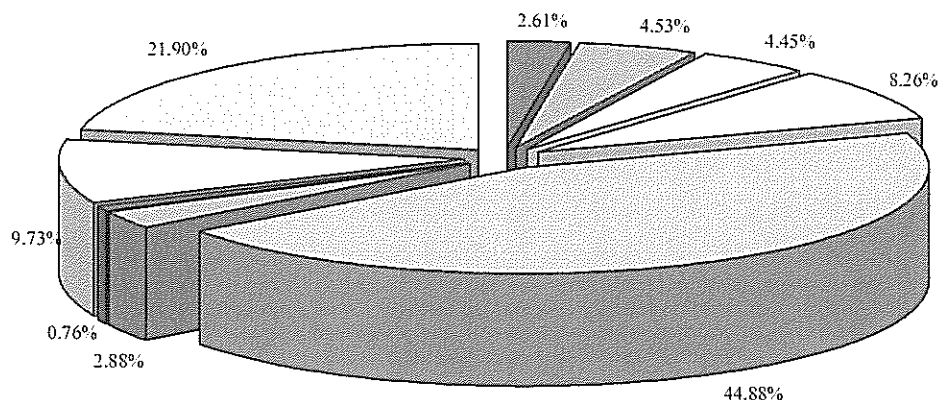
Структурата на портфейла на ДФ Ди Ви Хармония в края на периода е представена в следната таблица и графика.



Структура на портфейла на ДФ Ди Ви Хармония					
Актив	Стойност в лева 31.12.2016	Процент от активите 31.12.2016	Стойност в лева 30.06.2017	Процент от активите 30.06.2017	Валута (EUR USD BGN)
Акции - Фармацевтична промишленост	27,322	2.61%	41,184	3.83%	BGN
Акции - Енергетика	-	0.0%	11,489	1.07%	BGN
Акции - Финанси	-	0.0%	13,031	1.21%	BGN
Акции - Недвижими имоти	47,505	4.53%	49,699	4.62%	BGN
Акции - Тежка промишленост	46,624	4.45%	57,246	5.32%	BGN
Чуждестранни инвестиции	470,677	44.88%	489,533	45.51%	USD EUR
ДЦК	86,630	8.26%	-	0.0%	USD
Корпоративни облигации	30,235	2.88%	20,140	1.87%	EUR
Общински облигации	8,007	0.76%	-	0.0%	BGN
В брой и разплащателни сметки	102,048	9.73%	168,782	15.69%	EUR USD BGN
Вземания*	229,704	21.90%	224,549	20.88%	BGN
Обща сума	1,048,752	100.00%	1,075,653	100.00%	EUR USD BGN
<ul style="list-style-type: none">Вземания във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации , вземания от хеджиране и вземания от дивиденди.					

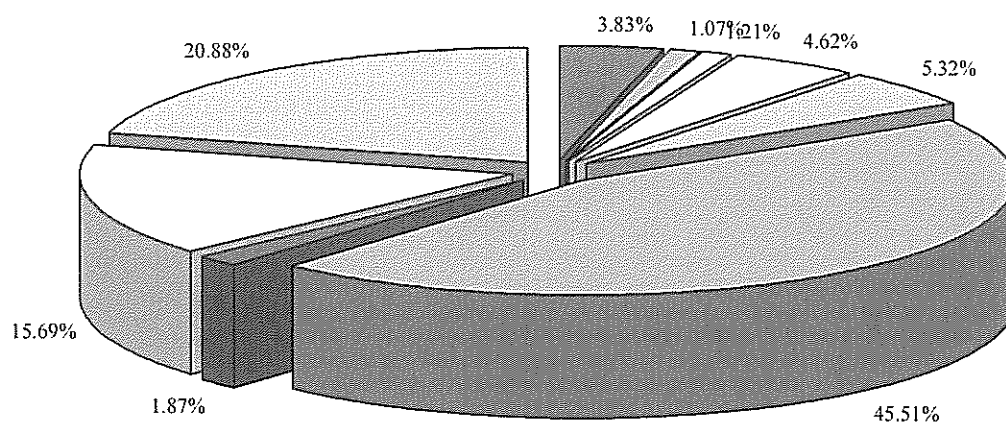


Разпределение на активите на Дн Ви Хармония към 31/12/2016



- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Недвижими имоти
- Акции - Тежка промишленост
- ДЦК
- Чуждестранни инвестиции
- Корпоративни облигации
- Общински облигации
- В брой и разплащателни сметки
- Вземания*

Разпределение на активите на Дн Ви Хармония към 30/06/2017



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



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

Към 30.06.2016 г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 9.4451 лв. На 31.12.2016 г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 9.2618 лв. Към 30.06.2017 г. нетната стойност на активите на един дял е 9.5179 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

	30/06/2016 (лв)	31/12/2016 (лв)	30/06/2017 (лв)
Нетна стойност на активите на „Ди Ви Хармония“	1,076,489	1,044,313	1,073,034
Нетна стойност на активите на един дял	9.4451	9.2618	9.5179




б) 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	28 837.810	1.0000	\$28 837.81
Валутно деноминиран актив	USD	73.000	241.8000	\$17 651.40
Валутно деноминиран актив	USD	676.000	48.9300	\$33 076.68
Валутно деноминиран актив	USD	193.000	120.5100	\$23 258.43
Валутно деноминиран актив	USD	99.000	113.4300	\$11 229.57
Валутно деноминиран актив	USD	622.000	50.9200	\$31 672.24
Валутно деноминиран актив	USD	92.000	123.5700	\$11 368.44
Обща рискова позиция				\$157 094.57

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 73 000.00	1.118600	\$81 657.80	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 66 000.00	1.127820	\$74 436.12	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$156 093.92		


Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД




Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД