



**ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО**

**ЧЛ. 75 т.2 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, 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 – София АД. Закупени са и са продадени чуждестранни инвестиции.

Към 30.06.2016 г. 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 30.06.2016 г. възлиза на 27.97%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 61.34% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Към 30.06.2016 г. корпоративните облигации представляват 0.73% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.06.2016 г. са 4.52% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии и вземане от дивиденди възлизат на 5.44% от активите на Фонда.

На 30.06.2016 г. нетната стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик е 1 165 167 лв., а нетната стойност на активите на един дял е 7.0023 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 30.06.2016г. Приходите са в размер на 719 505 лв., включващи приходи от операции с финансови активи, приходи от лихви, положителни курсови разлики и други финансови приходи.



Приходи	Стойност в лева		
	30/06/15	31/12/15	30/06/16
Приходи от лихви	3 301	5 831	1 593
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	506 965	1 125 999	510 970
Положителни курсови разлики	201 215	375 686	198 812
Други финансови приходи	13 957	23 012	8 130
<b>Общо приходи:</b>	<b>725 438</b>	<b>1 530 528</b>	<b>719 505</b>

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

Разходи	Стойност в лева		
	30/06/15	31/12/15	30/06/16
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	558 149	1 241 266	590 514
Отрицателни курсови разлики	197 177	373 220	200 803
Разходи за външни услуги	19 421	35 638	14 912
Други финансови разходи	8 763	89 169	54 066
<b>Общо разходи:</b>	<b>783 510</b>	<b>1 739 293</b>	<b>860 295</b>

Общият размер на разходите на фонда към 30.06.2016г. е 860 295 лева, които включват 590 514 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти, 200 803 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 30.06.2016г. – 11 374 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.90%

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

- към 30.06.2016г. – 105 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.00%

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 30.06.2016г. – 1 200 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.10%

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

- към 30.06.2016г. – 1 776 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.14%

д) Други разходи

- към 30.06.2016г. – 54 523 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 4.32%



- Други разходи по финансови операции: 53 961 лв.
- Външни услуги (КФН, БФБ, ЦД и други услуги): 562 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 68 978 лв. към месец юни 2016. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 5.46%.

	Стойност в лева		
	30/06/15	31/12/15	30/06/16
Общо Приходи	725 438	1 530 528	719 505
Общо Разходи	783 510	1 739 293	860 295
<b>Нетен Резултат</b>	<b>(58 072)</b>	<b>(208 765)</b>	<b>(140 790)</b>

За периода са записани 699.4687 и са обратно изкупени 5 895.0604 броя дялове. НСА на фонда към 30.06.2015г. е 1 605 105 лв., към 31.12.2015 г. е 1 344 447 лв., а към 30.06.2016г. е 1 165 167 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 166 397,4920.

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

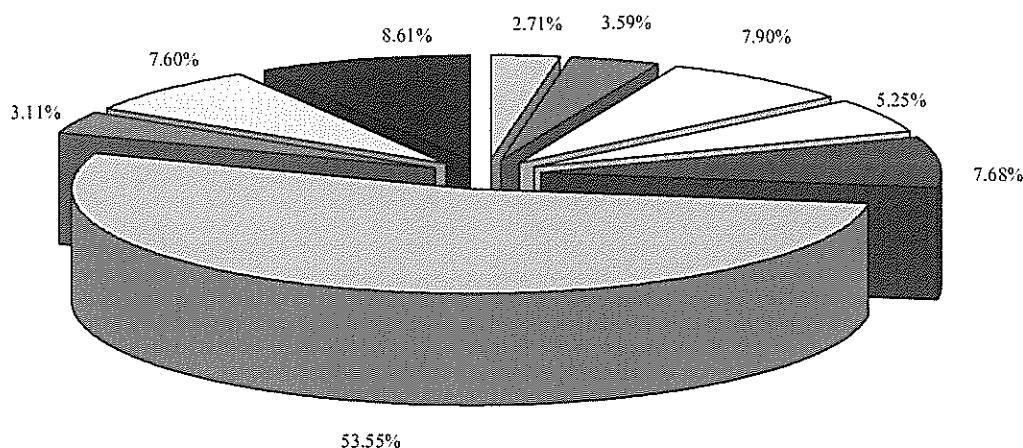
Структурата на портфейла на ДФ Ди Ви Динамик в края на периода е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ „Ди Ви Динамик“					
Актив	Стойност в лева 31.12.2015	Процент от активите 31.12.2015	Стойност в лева 30.06.2016	Процент от активите 30.06.2016	Валута
					(EUR, USD, BGN)
Акции - Туризъм	36 585	2.71%	29 570	2.51%	BGN
Акции - Фармацевтична промишленост	48 537	3.59%	40 465	3.44%	BGN
Акции - Енергетика	106 843	7.90%	102 145	8.68%	BGN
Акции - Недвижими имоти	70 915	5.25%	68 751	5.84%	BGN
Акции - Тежка промишленост	103 828	7.68%	88 318	7.50%	BGN
Чуждестранни инвестиции	723 953	53.55%	722 245	61.34%	USD, EUR
Корпоративни облигации	42 040	3.11%	8 565	0.73%	EUR
В брой и разплащателни сметки	102 757	7.60%	53 240	4.52%	EUR, USD, BGN
Вземания*	116 324	8.61%	64 017	5.44%	BGN
<b>Общо активи</b>	<b>1 351 782</b>	<b>100.00%</b>	<b>1 177 316</b>	<b>100.00%</b>	<b>EUR, USD, BGN</b>

\* Вземания във връзка с начислени дивиденди и лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации.



Разпределение на активите на Дн Ви Динамик към 31/12/2015



Акции - Туризъм

Акции - Фармацевтична промишленост

Акции - Енергетика

Акции - Недвижими имоти

Акции - Тежка промишленост

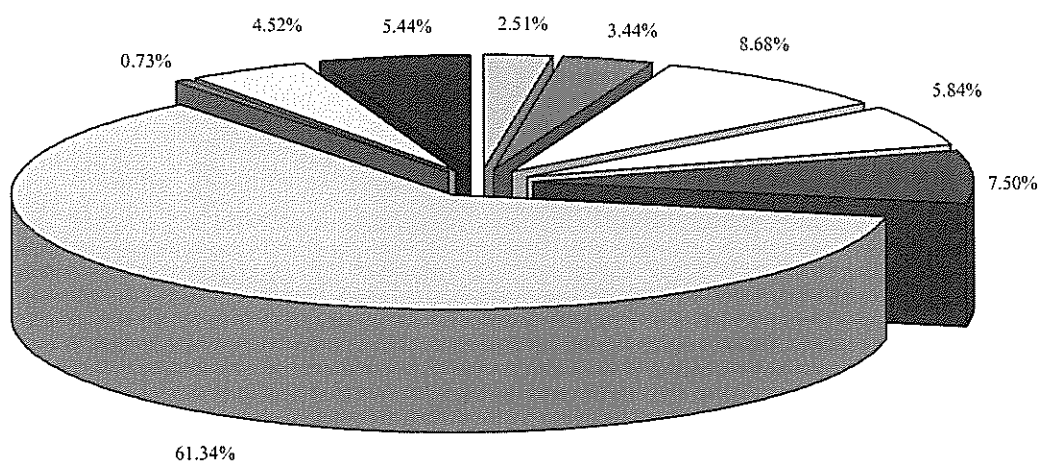
Чуждестранни инвестиции

Корпоративни облигации

В брой и разплащателни сметки

Вземания\*

Разпределение на активите на Дн Ви Динамик към 30/06/2016



Акции - Туризъм

Акции - Фармацевтична промишленост

Акции - Енергетика

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 30.06.2015 г. нетна стойност на активите на един дял е 8.6828 лв. На 31.12.2015 г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 7.8351 лв. Към 30.06.2016 г. нетната стойност на активите на един дял е 7.0023 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**

	30/06/2015 (лв)	31/12/2015 (лв)	30/06/2016 (лв)
Нетна стойност на активите на „Ди Ви Динамик“	1 605 105	1 344 447	1 165 167
Нетна стойност на активите на един дял	8.6828	7.8351	7.0023



**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	1 703.240	1.0000	\$1 703.24
Валутно деноминиран актив	USD	1 000.000	46.210	\$46 210.00
Валутно деноминиран актив	USD	337.000	107.540	\$36 240.98
Валутно деноминиран актив	USD	1 405.000	38.250	\$53 741.25
Валутно деноминиран актив	USD	200.000	209.4750	\$41 895.00
Обща рискова позиция				\$179 790.47

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 100 000.00	1.138510	\$113 851.00	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 54 000.00	1.135690	\$61 327.26		
Обща хеджираща позиция				\$175 178.26		

  
Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД



  
Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД