

**ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО  
ЧЛ. 73, 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, т. 5 от Наредба № 44**

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

Съгласно балансираната инвестиционна политика и стратегия на Ди Ви Хармония, през 2017 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност, акции на публични дружества и дялове на борсово търгувани фондове.

Към 31.12.2017 г. акциите и правата на български компании в портфейла на ДФ Ди Ви Хармония са разпределени в 6 икономически сектора. Общият дял на тези ценни книжа в активите на Фонда към 31.12.2017 г. възлиза на 22.31%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 44.45% от активите на ДФ Ди Ви Хармония.

Към 31.12.2017 г. корпоративните облигации представляват 1.58% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Хармония.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.12.2017 г. са 12.19% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, вземанията от хеджиране и вземанията от дивиденди възлизат на 19.47% от активите на Фонда.

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

За периода са записани 230.6827 дяла и са обратно изкупени 2,907.4302 дяла. Броят дялове към края на отчетния период е 110,078.4992.

Долната таблица представя приходите на Фонда към 31.12.2017 г. Приходите са в размер на 703,841 лева, включващи приходи от операции с финансови активи, приходи от лихви, положителни курсови разлики и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лева	
	30.06.2017	31.12.2017
Приходи от лихви	1,727	2,474
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	206,783	406,333
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	148,692	279,366
Други финансови приходи	8,116	15,668
<b>Общо приходи</b>	<b>365,318</b>	<b>703,841</b>

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

Разходи	Стойност в лева	
	30.06.2017	31.12.2017
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	180,569	417,438
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	151,281	285,134
Разходи за външни услуги	3,562	7,099
Други разходи	1,032	1,902
<b>Общо разходи</b>	<b>336,444</b>	<b>711,573</b>

Общият размер на разходите на Фонда към 31.12.2017 г. е 711,573 лева, които включват 417,438 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти, отрицателни валутни курсови разлики в размер на 285,134 лева, други разходи в размер на 1,902 лева и разходи за външни услуги в размер на 7,099 лева, представени подробно по-долу.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество
  - към 31 декември 2017 – 0 лв.
  - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.00%
- б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество
  - към 31 декември 2017 – 60 лв.
  - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.01%
- в) Възнаграждение на банката депозитар
  - към 31 декември 2017 – 2,400 лв.
  - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.23%
- г) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие
  - към 31 декември 2017 – 3,600 лв.
  - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.34%
- д) Други разходи по финансови операции:
  - към 31 декември 2017 – 1,842 лв.
  - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.17%

е) Разходи за външни услуги (КФН, ЦД и др.):

- към 31 декември 2017 – 1,099 лв.

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

ж) Общ размер на всички разходи по букви а) – ж) – 9,001 лв. към 31.12.2017 г.

Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 0.85%.

	Стойност в лева	
	30.06.2017	31.12.2017
Общо приходи	365,318	703,841
Общо разходи	336,444	711,573
<b>Нетен резултат</b>	<b>28,874</b>	<b>(7,732)</b>

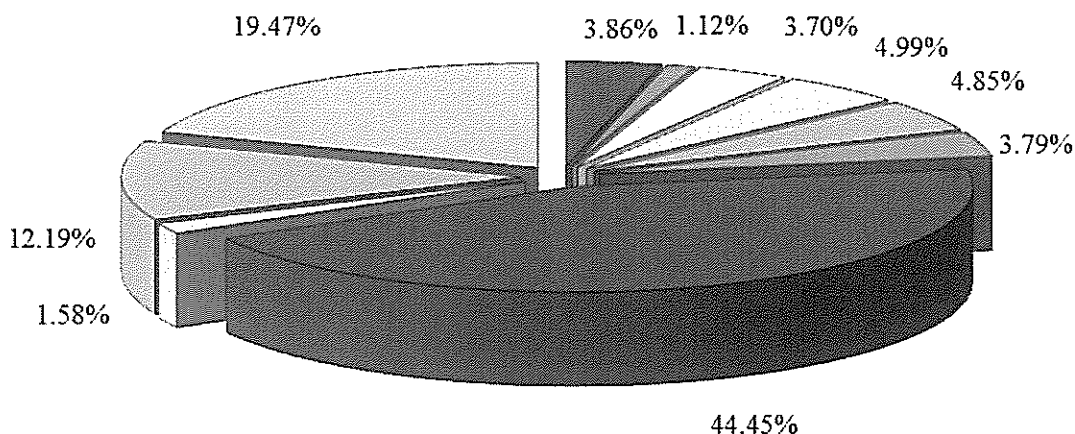
### 3) Данни по чл. 73, т. 5, б. „в” и „г”: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

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" към 31/12/2017					
Актив	Стойност в лева	Процент от активите	Стойност в лева	Процент от активите	Валута
	31.12.2016	31.12.2016	31.12.2017	31.12.2017	
					(EUR, USD, BGN)
Акции - Енергетика	-	-	11,382	1.12%	BGN
Акции - Фармацевтична промишленост	27,322	2.61%	39,198	3.86%	BGN
Акции - Недвижими имоти	47,505	4.53%	50,670	4.99%	BGN
Акции и права - Тежка промишленост	46,624	4.45%	49,206	4.85%	BGN
Акции – Финанси	-	0.00%	37,600	3.70%	BGN
Акции – Лека промишленост	-	0.00%	38,518	3.79%	BGN
Чуждестранни инвестиции	470,677	44.88%	451,349	44.45%	EUR, USD
ДЦК	86,630	8.26%	-	0.00%	USD
Корпоративни облигации	30,235	2.88%	16,037	1.58%	EUR
Общински облигации	8,007	0.76%	-	0.00%	BGN
В брой и разплащателни сметки	102,048	9.73%	123,777	12.19%	BGN, EUR, USD
Вземания*	229,704	21.90%	197,742	19.47%	BGN, EUR
<b>Общо активи</b>	<b>1,048,752</b>	<b>100.00%</b>	<b>1,015,479</b>	<b>100.00%</b>	

\* Вземания във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, вземания от хеджиране и вземания от дивиденди.

Разпределение на активите на Ди Ви Хармония към 31/12/2017



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

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

Нетната стойност на активите на един дял на Фонда към 31.12.2016 г. е 9.2618 лева. Към 30.06.2017 г. нетната стойност на активите на един дял е 9.5179 лв. Към 31.12.2017 г. нетната стойност на активите на един дял е 9.1850 лв.

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



- 5) Данни по чл. 73, 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 2015 (в лева)	Към 31 Декември 2016 (в лева)	Към 31 Декември 2017 (в лева)
Нетна стойност на активите	495,042	1,044,313	1,011,072
Нетна стойност на активите на един дял	10.0194	9.2618	9.1850

- б) Данни по чл. 73, 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	32,341.97	1.000	\$32,341.97
Валутно деноминиран актив	USD	99.00	114.080	\$11,293.92
Валутно деноминиран актив	USD	193.00	121.560	\$23,461.08
Валутно деноминиран актив	USD	84.00	136.010	\$11,424.84
Валутно деноминиран актив	USD	676.00	52.780	\$35,679.28
Валутно деноминиран актив	USD	73.00	266.860	\$19,480.78

<b>Обща рискова позиция</b>	<b>\$133,681.87</b>
-----------------------------	---------------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 73,000.00	1.1887	\$86,775.10	ОТС	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 40,000.00	1.1833	\$47,332.00	ОТС	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>				<b>\$134,107.10</b>		

  
Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД



  
Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД