

**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 ДИНАМИК”**

**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 инвестиционната политика и стратегия на Фонда за инвестиране предимно в акции, търгувани на регулираните пазари в страната и чужбина, през 2017 г. продължават покупките и продажбите на акции от български публични дружества, търгувани на БФБ – София АД. Закупени са и са продадени чуждестранни инвестиции.

Към 31.12.2017 г. акциите и правата на български компании в портфейла на ДФ Ди Ви Динамик са разпределени в 6 икономически сектора. Общият дял на тези ценни книжа в активите на Фонда към 31.12.2017 г. възлиза на 29.14%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 49.19% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.12.2017 г. са 19.06% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, вземанията от дивиденди и вземанията от хеджиране възлизат на 2.61% 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 емитирани 4,317.6384 дяла, а обратно са изкупени 16,309.5764 броя дялове. НСА на Фонда към 31.12.2016 г. е 1,216,395 лв., а към 31.12.2017 г. е 1,237,916 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 147,711.6746.

Долната таблица представя приходите на Фонда към 31.12.2017 г. Приходите са в размер на 1,236,428 лв., 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                                     | 1,403           | 1,718            |
| Приходи от операции с финансови активи и инструменти | 439,119         | 854,875          |
| Положителни разлики от промяна на валутни курсове    | 167,985         | 338,582          |
| Други финансови приходи                              | 9,688           | 41,253           |
| <b>Общо приходи</b>                                  | <b>618,195</b>  | <b>1,236,428</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 | 297,067         | 739,277          |
| Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове    | 169,806         | 344,476          |
| Други разходи  | 1,031           | 1,949            |
| Разходи за външни услуги                             | 14,804          | 29,807           |
| <b>Общо разходи</b>                                  | <b>482,708</b>  | <b>1,115,509</b> |

Общият размер на разходите на Фонда към 31.12.2017 г. е 1,115,509 лева, които включват 739,277 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 344,476 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове, както и разходи за външни услуги и други разходи общо в размер на 31,756 лева, които са представени подробно по-долу.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество
    - към 31.12.2017 г. – 22,708 лв.
    - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.79%
  
  - б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество
    - към 31.12.2017 г. – 289 лв.
    - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.02%
  
  - в) Възнаграждение на банката депозитар
    - към 31.12.2017 г. – 2,400 лв.
    - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.19%
  
  - г) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие
    - към 31.12.2017г. – 3,600 лв.
    - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.28%
  
  - д) Други разходи
    - към 31.12.2017 г. – 2,759 лв.
    - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.22%
- Други разходи по финансови операции: 1,660 лв.  
Външни услуги (КФН, ЦД и други услуги): 1,099 лв.



е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 31,756 лв. към 31.12.2017 г. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 2.50%.

|                       | Стойност в лева |                |
|-----------------------|-----------------|----------------|
|                       | 30.06.2017      | 31.12.2017     |
| Общо приходи          | 618,195         | 1,236,428      |
| Общо разходи          | 482,708         | 1,115,509      |
| <b>Нетен резултат</b> | <b>135,487</b>  | <b>120,919</b> |

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

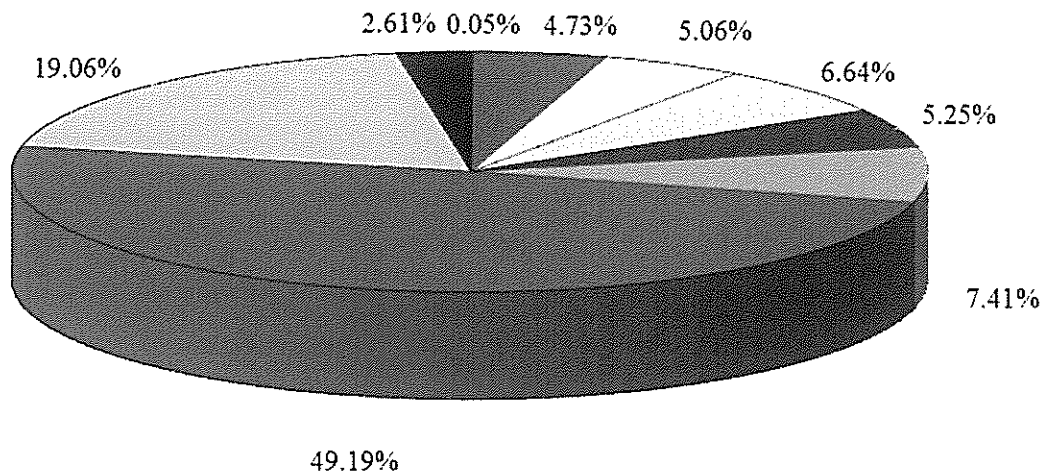
Структурата на портфейла на ДФ „Ди Ви Динамик” в края на периода е представена в следната таблица и графика:

| Структура на портфейла на ДФ Ди Ви Динамик |                               |                                   |                               |                                   |                      |
|--|-------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------|-----------------------------------|----------------------|
| Актив                                      | Стойност в лева<br>31.12.2016 | Процент от активите<br>31.12.2016 | Стойност в лева<br>31.12.2017 | Процент от активите<br>31.12.2017 | Валута               |
|  |                               |                                   |                               |                                   | (EUR, USD, BGN)      |
| Акции - Туризъм                            | 40,733                        | 3.34%                             | 635                           | 0.05%                             | BGN                  |
| Акции - Фармацевтична промишленост         | 61,022                        | 5.00%                             | 58,717                        | 4.73%                             | BGN                  |
| Акции - Енергетика                         | 67,200                        | 5.50%                             | 62,872                        | 5.06%                             | BGN                  |
| Акции - Финанси                            | 2,798                         | 0.23%                             | 82,566                        | 6.64%                             | BGN                  |
| Акции - Недвижими имоти                    | 60,678                        | 4.97%                             | 65,210                        | 5.25%                             | BGN                  |
| Акции и права - Тежка промишленост         | 63,254                        | 5.18%                             | 92,120                        | 7.41%                             | BGN                  |
| Чуждестранни инвестиции                    | 701,784                       | 57.47%                            | 611,223                       | 49.19%                            | USD, EUR             |
| Корпоративни облигации                     | 9,830                         | 0.81%                             | -                             | -                                 | EUR                  |
| В брой и разплащателни сметки              | 161,365                       | 13.21%                            | 236,871                       | 19.06%                            | EUR, USD, BGN        |
| Вземания*                                  | 52,412                        | 4.29%                             | 32,423                        | 2.61%                             | EUR, USD, BGN        |
| <b>Общо активи</b>                         | <b>1,221,076</b>              | <b>100.00%</b>                    | <b>1,242,637</b>              | <b>100.00%</b>                    | <b>EUR, USD, BGN</b> |

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



**Разпределение на активите на Ди Ви Динамик към 31/12/2017**

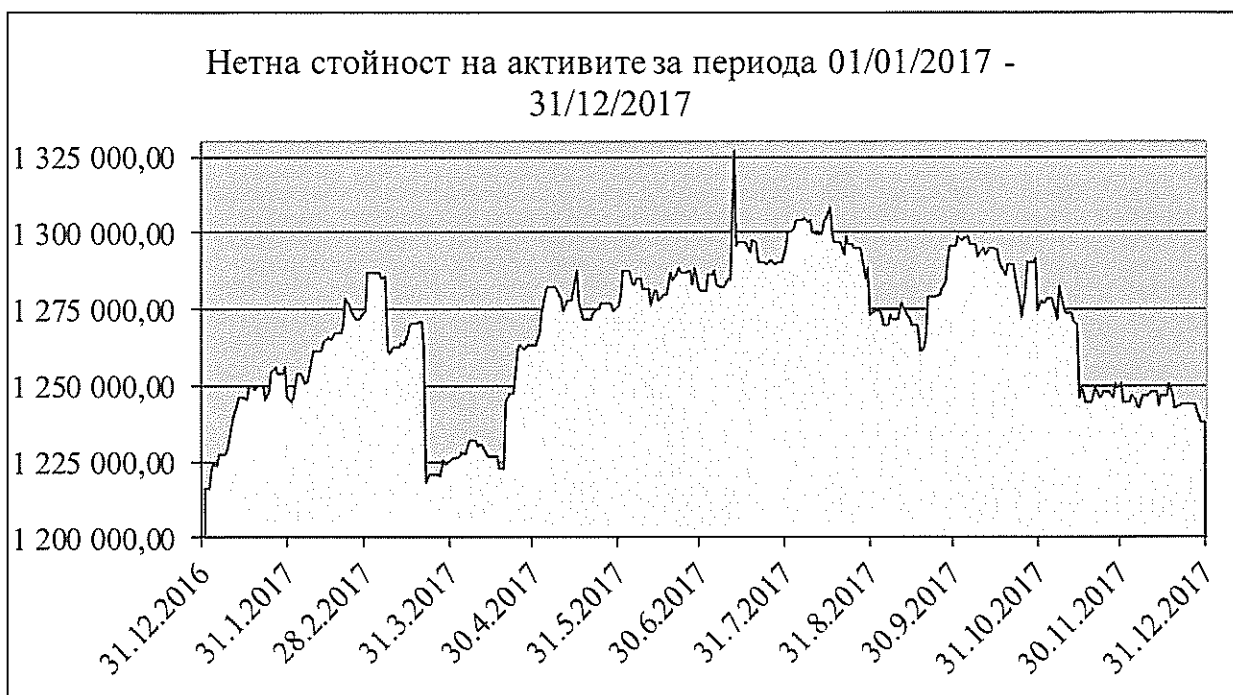


- |  |   |
|--|---|
| <input type="checkbox"/> Акции - Туризъм         | <input type="checkbox"/> Акции - Фармацевтична промишленост |
| <input type="checkbox"/> Акции - Енергетика      | <input type="checkbox"/> Акции - Финанси                    |
| <input type="checkbox"/> Акции - Недвижими имоти | <input type="checkbox"/> Акции - Тежка промишленост         |
| <input type="checkbox"/> Чуждестранни инвестиции | <input type="checkbox"/> В брой и разплащателни сметки      |
| <input type="checkbox"/> Вземания*               |   |

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

На 31.12.2016 г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 7.6166 лв. На 30.06.2016 г. нетната стойност на активите на един дял е в размер на 8.4821 лв. Към 31.12.2017 г. нетната стойност на активите на един дял е 8.3806 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<br>31 декември 2015<br>в лева | Към<br>31 декември 2016<br>в лева | Към<br>31 декември 2017<br>в лева |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------------------|
| Нетна стойност на активите             | 1,344,447                         | 1,216,395                         | 1,237,916                         |
| Нетна стойност на активите на един дял | 7.8351                            | 7.6166                            | 8.3806                            |

- 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    | 34 054,270 | 1,0000  | \$34 054,27   |
| Валутно деноминиран актив | USD    | 129,000    | 266,860 | \$34 424,94   |
| Валутно деноминиран актив | USD    | 337,000    | 155,760 | \$52 491,12   |
| Валутно деноминиран актив | USD    | 350,000    | 124,340 | \$43 519,00   |
| Валутно деноминиран актив | USD    | 837,000    | 52,780  | \$44 176,86   |

|                      |              |
|----------------------|--------------|
| Обща рискова позиция | \$208 666,19 |
|----------------------|--------------|

| Деривативен инструмент |         |              |          |               |       |          |
|------------------------|---------|--------------|----------|---------------|-------|----------|
| Вид                    | Валута  | Брой         | Цена     | Обща Стойност | Пазар | Държава  |
| Форуърд купува EUR/USD | EUR/USD | € 100 000,00 | 1,188700 | \$118 870,00  | OTC   | България |
| Форуърд купува EUR/USD | EUR/USD | € 76 000,00  | 1,187065 | \$90 216,94   | OTC   | България |
| Обща хеджираща позиция |         |              |          | \$209 086,94  |       |          |

  
Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД



  
Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД