



**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 периода продължават покупките и продажбите на акции от български публични дружества, търгувани на БФБ – София АД. Закупени са и са продадени чуждестранни инвестиции.

Към 31.12.2016 г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ди Ви Динамик са разпределени в 6 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 31.12.2016 г. възлиза на 24.22%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 57.47% от активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Към 31.12.2016 г. корпоративните облигации представляват 0.81% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.12.2016 г. са 13.21% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, вземане от хеджиране и вземане от дивиденди възлизат на 4.29% 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

Долната таблица представя приходите на Фонда към 31.12.2016 г. Приходите са в размер на 1,360,001 лв., включващи приходи от операции с финансови активи, приходи от лихви, положителни курсови разлики и други финансови приходи.



Приходи	Стойност в лева	
	30.06.2016	31.12.2016
Приходи от лихви	1,593	3,141
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	510,970	973,991
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	198,812	363,620
Други финансови приходи	8,130	19,249
Общо приходи	719,505	1,360,001

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

Разходи	Стойност в лева	
	30.06.2016	31.12.2016
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	590,514	947,547
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	200,803	369,182
Други разходи	54,066	55,370
Разходи за външни услуги	14,912	29,203
Общо разходи	860,295	1,401,302

Общият размер на разходите на Фонда към 31.12.2016 г. е 1,401,302 лева, които включват 947,547 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 369,182 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове, както и разходи за външни услуги и други разходи общо в размер на 84,573 лева, които са представени подробно по-долу.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 31.12.2016 г. – 22,104 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 31.12.2016 г. – 439 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.04%

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 31.12.2016 г. – 2,400 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.20%

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

- към 31.12.2016г. – 3,600 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.29%

д) Други разходи

- към 31.12.2016 г. – 56,030 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 4.58%

Други разходи по финансови операции: 54,931 лв.

Външни услуги (КФН, ЦД и други услуги): 1,099 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 84,573 лв. към 31.12.2016 г. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 6.91%.

	Стойност в лева	
	30.06.2016	31.12.2016
Общо приходи	719,505	1,360,001
Общо разходи	860,295	1,401,302
Нетен резултат	(140,790)	(41,301)

За периода са емитирани 699.4687 дяла, а обратно са изкупени 12,588.9398 броя дялове. НСА на Фонда към 31.12.2015 г. е 1,344,447 лв., а към 31.12.2016 г. е 1,216,395 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 159,703.6126.

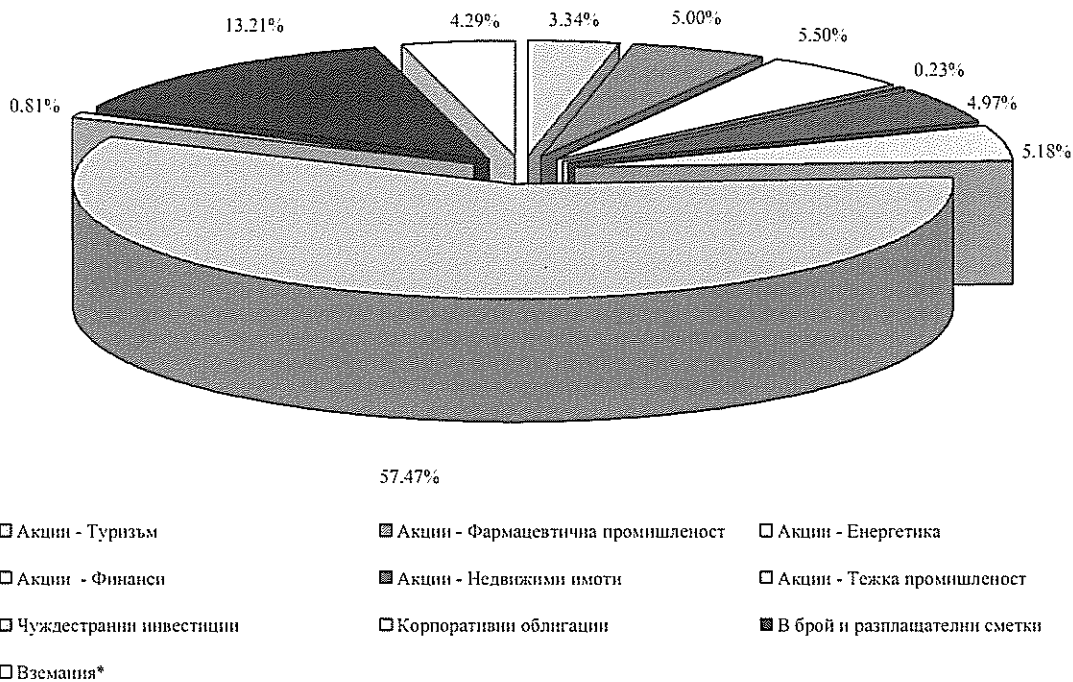
3) Данни по чл. 73, т. 5, б. „в” и „г”: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

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 31.12.2015	Процент от активите 31.12.2015	Стойност в лева 31.12.2016	Процент от активите 30.06.2016	Валута
					(EUR, USD, BGN)
Акции - Туризм	36,585	2.71%	40,733	3.34%	BGN
Акции - Фармацевтична промишленост	48,537	3.59%	61,022	5.00%	BGN
Акции - Енергетика	106,843	7.90%	67,200	5.50%	BGN
Акции - Финанси	-	0.00%	2,798	0.23%	BGN
Акции - Недвижими имоти	70,915	5.25%	60,678	4.97%	BGN
Акции - Тежка промишленост	103,828	7.68%	63,254	5.18%	BGN
Чуждестранни инвестиции	723,953	53.55%	701,784	57.47%	USD, EUR
Корпоративни облигации	42,040	3.11%	9,830	0.81%	EUR
В брой и разплащателни сметки	102,757	7.60%	161,365	13.21%	EUR, USD, BGN
Вземания*	116,324	8.61%	52,412	4.29%	EUR, USD, BGN
Общо активи	1,351,782	100.00%	1,221,076	100.00%	EUR, USD, BGN

* Вземания във връзка с начислени дивиденди, лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации и вземане от хеджиране

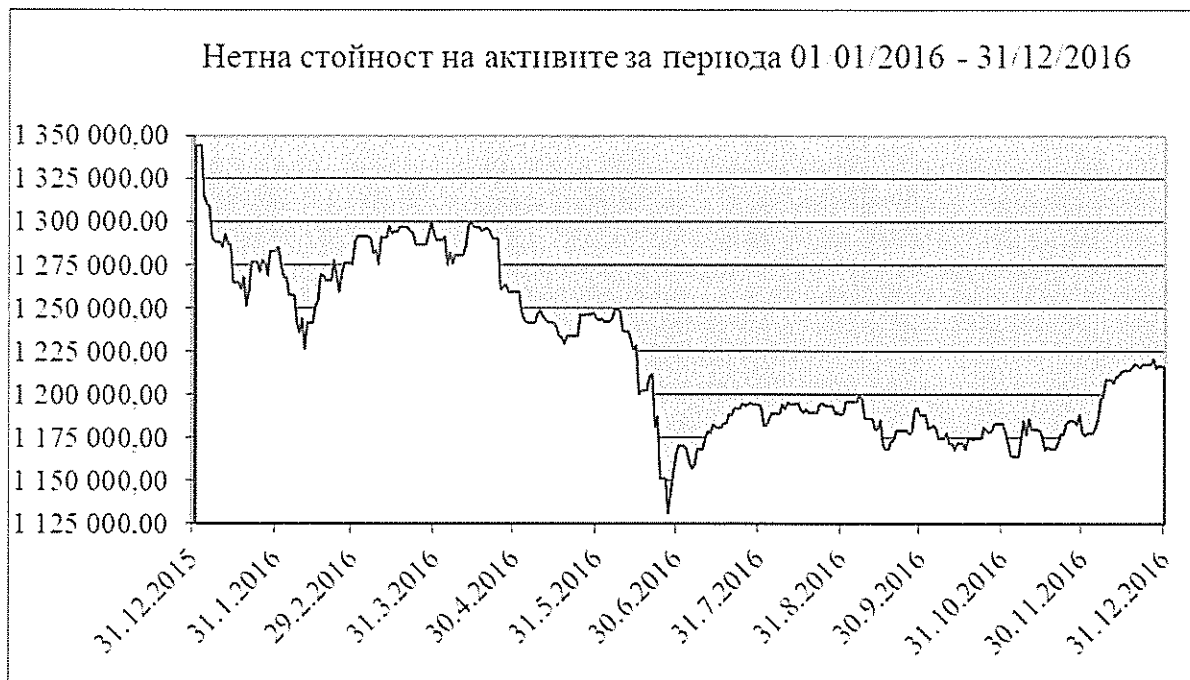
Разпределение на активите на Дн Ви Динамик към 31/12/2016



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

На 31.12.2015 г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 7.8351 лв. На 30.06.2016 г. нетната стойност на активите на един дял е в размер на 7,0023 лв. Към 31.12.2016 г. нетната стойност на активите на един дял е 7.6166 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 2014 в лева	Към 31 декември 2015 в лева	Към 31 декември 2016 в лева
Нетна стойност на активите	1,698,527	1,344,447	1,216,395
Нетна стойност на активите на един дял	8.9950	7.8351	7.6166

- 6) 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	492.340	1.0000	\$492.34
Валутно деноминиран актив	USD	387.000	101.380	\$39,234.06
Валутно деноминиран актив	USD	350.000	112.030	\$39,210.50
Валутно деноминиран актив	USD	337.000	118.480	\$39,927.76
Валутно деноминиран актив	USD	259.000	223.5300	\$57,894.27
Обща рискова позиция				\$176,758.93

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€100,000.00	1.047280	\$104,728.00	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€68,000.00	1.041670	\$70,833.56		
Обща хеджираща позиция				\$175,561.56		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД



Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД