

СПРАВКИ	
за договорни фондове и инвестиционни дружества	
Данни за отчетния период	
Начална дата:	01.01.2020
Крайна дата:	30.06.2020
Дата на изготвяне на отчета:	17.07.2020
Данни за подназорното лице	
Наименование на ДФ/ИД: ДФ АЛФА СОФИХ ИНДЕКС	
Номер РГ:	РГ 05-1279
ЕИК:	175114862
Адрес на управление:	гр. София, ул. Кракра 18
Адрес за кореспонденция:	гр. София, ул. Кракра 18
Телефон:	024210513
E-mail:	aan@alfafunds.com
Данни за управляващото дружество	
Наименование на УД: АЛФА АСЕТ МЕНИДЖЪНТ ЕАД	
Номер РГ:	08-17
ЕИК:	175037316
Представяващ:	ИВАН НЕНКОВ, МАЯ ЯНКОВА, ЛЮБОМИР ЕВСТАТИЕВ
Данни за представените справки	
Съставител:	Спаска Спасова-Димова
Длъжност:	Счетоводител, Велес Акаунт ЕООД
Телефон:	02/4111444
E-mail:	accounting@alfafunds.com

ОТЧЕТ ЗА ФИНАНСОВОТО СЪСТОЯНИЕ
на ДФ АЛФА СОФИХ ИНДЕКС
към 30.06.2020 г.

Дата: 17.7.2020 г.

Съставител: Спасака Спасова-Димова
Ръководител: ИВАН НЕЕНКОВ, МАЯ ЯНКОВА.

(в злва)

АКТИВИ	Код	Текущ период	Преходен период	СОВОБСТВЕН КАПИТАЛ И ПАСИВИ	Код	Текущ период	Преходен период
	6	1	2		6	1	2
A. НЕТЕКУЩИ АКТИВИ				A. СОВОБСТВЕН КАПИТАЛ			
I. Финансови активи				I. Основен капитал	SB.2.1.1.0.0	984803	1038474
1. Целни книжа, в т.ч.:	SB.1.1.1.0.0	0	0	II. Резерви	SB.2.1.2.1.0.0	2110898	2083429
акции	SB.1.1.1.1.0			1. Премийни резерви при емипиране/обратно изкупуване на акции/дългове	SB.2.1.2.2.0.0		
дългови	SB.1.1.1.2.0			2. Резерви от последващи оценки на активи и пасиви	SB.2.1.2.3.0.0		
2. Други финансови инструменти	SB.1.1.2.0.0	0	0	3. Общи резерви	SB.2.1.2.0.0.0	2110898	2083429
II. Други нетекущи активи	SB.1.1.2.0.0			III. Финансов резултат			
ОБЩО ЗА ГРУПА I A	SB.1.1.0.0.0	0	0	0 I. Накупена печалба (загуба), в т.ч.:	SB.2.1.3.1.0.0	-2577130	-2535891
Б. ТЕКУЩИ АКТИВИ				неразпределена печалба	SB.2.1.3.1.1.0		
I. Парични средства				непокрита загуба	SB.2.1.3.1.2.0	-2577130	-2535891
1. Парични средства в каса	SB.1.2.1.1.0.0			2. Текуща печалба	SB.2.1.3.2.0.0	-100677	-41238
2. Парични средства по безсрочни депозити	SB.1.2.1.2.0.0	26390	53318	3. Текуща загуба	SB.2.1.3.3.0.0	-2677807	-2577130
3. Парични средства по срочни депозити	SB.1.2.1.3.0.0			ОБЩО ЗА ГРУПА III	SB.2.1.3.0.0.0	-417894	544774
4. Блокирани парични средства	SB.1.2.1.4.0.0			ОБЩО ЗА ГРУПА I A	SB.2.1.0.0.0.0		
ОБЩО ЗА ГРУПА I	SB.1.2.1.0.0.0	26390	53318	Б. ТЕКУЩИ ПАСИВИ			
II. Текущи финансови инструменти				I. Задължения, свързани с дивиденди	SB.2.2.1.1.0.0		
1. Целни книжа, в т.ч.:	SB.1.2.2.1.0.0	387609	491056	1. Задължения към финансови институции, в т.ч.:	SB.2.2.1.2.0.0	638	739
акции	SB.1.2.2.1.1.0	387609	491056	2. Задължения към банки депозитар	SB.2.2.1.2.1.0	287	290
права	SB.1.2.2.1.2.0			към банка депозитар	SB.2.2.1.2.2.0	351	449
дългови	SB.1.2.2.1.3.0			към управляващо дружество	SB.2.2.1.2.3.0		
2. Инструменти на паричния пазар	SB.1.2.2.1.4.0			към кредитни институции	SB.2.2.1.3.0.0	97	82
3. Дългове на колективни инвестиционни схеми	SB.1.2.2.2.0.0			3. Задължения към контрагенти	SB.2.2.1.4.0.0		
4. Държавни финансови инструменти	SB.1.2.2.3.0.0			4. Задължения, свързани с външнораздадени	SB.2.2.1.5.0.0		
5. Блокирани	SB.1.2.2.4.0.0			5. Задължения към осигурителни предприятия	SB.2.2.1.6.0.0		
6. Други финансови инструменти	SB.1.2.2.5.0.0			6. Дългични задължения	SB.2.2.1.7.0.0		
ОБЩО ЗА ГРУПА II	SB.1.2.2.6.0.0			7. Задължения, свързани с емипиране	SB.2.2.1.8.0.0		
III. Нефинансови активи	SB.1.2.2.0.0.0	387609	491056	8. Задължения, свързани с обратно изкупуване	SB.2.2.1.9.0.0		
1. Вземания, свързани с дълги	SB.1.2.3.1.0.0			9. Задължения, свързани със сделки с финансови инструменти	SB.2.2.1.10.0.0		
2. Вземания по сделки с финансови инструменти	SB.1.2.3.2.0.0			ОБЩО ЗА ГРУПА II B	SB.2.2.0.0.0.0	735	822
3. Вземания, свързани с емипиране	SB.1.2.3.3.0.0	4629	1222				
4. Други	SB.1.2.3.4.0.0	4629	1222				
ОБЩО ЗА ГРУПА III	SB.1.2.3.0.0.0						
IV. Разходи за бъдещи периоди	SB.1.2.4.0.0.0						
ОБЩО ЗА РАЗДЕЛ B	SB.1.2.0.0.0.0	418628	545595				
СУМА НА АКТИВА	SB.1.0.0.0.0.0	418628	545595	СУМА НА ПАСИВА	SB.2.0.0.0.0.0	418628	545595

ОТЧЕТ ЗА ВСЕОБХВАТНИЯ ДОХОД
на ДФ АЛФА SOFIX ИНДЕКС
за периода 01.01.2020 - 30.06.2020

Дата: 17.7.2020 г.

Съставител: Спаска Спасова-Димова

Ръководител: ИВАН НЕНКОВ, МАЯ ЯНКО

(в лева)

РАЗХОДИ	Код	Текущ период	Предходен период	ПРИХОДИ	Код	Текущ период	Предходен период
а	б	1	2	а	б	1	2
А. Разходи за дейността				А. Приходи от дейността			
I. Финансови разходи				I. Финансови приходи			
1. Разходи за лихви	OD.1.1.1.0.0			1. Приходи от дивиденди	OD.2.1.1.0.0	4620	7909
2. Отрицателни разлики от операции с финансови активи	OD.1.1.1.2.0.0	745	1239	2. Положителни разлики от операции с финансови активи	OD.2.1.1.2.0.0	6573	1099
3. Отрицателни разлики от последваща оценка на финансови активи	OD.1.1.1.2.1.0	444866	345562	3. Положителни разлики от последваща оценка на финансови активи	OD.2.1.1.2.1.0	341771	326865
4. Разходи, свързани с валутни операции	OD.1.1.1.3.0.0			4. Приходи, свързани с валутни операции	OD.2.1.1.3.0.0		
5. Други финансови разходи	OD.1.1.1.4.0.0	2656	3533	5. Приходи от лихви	OD.2.1.1.4.0.0	15	104
				6. Други	OD.2.1.1.5.0.0		
Общо за група I	OD.1.1.1.0.0.0	448266	350334	Общо за група I	OD.2.1.1.0.0.0	352979	335976
II. Нефинансови разходи				II. Нефинансови приходи			
1. Разходи за материали	OD.1.1.2.1.0.0						
2. Разходи за външни услуги	OD.1.1.2.2.0.0	5390	6254				
3. Разходи за амортизация	OD.1.1.2.3.0.0						
4. Разходи, свързани с възнаграждения	OD.1.1.2.4.0.0						
5. Други	OD.1.1.2.5.0.0						
Общо за група II	OD.1.1.2.0.0.0	5390	6254	Общо за група II	OD.2.1.2.0.0.0		
Б. Общо разходи за дейността (I+II)	OD.1.1.0.0.0.0	453656	356588	Б. Общо приходи от дейността (I+II)	OD.2.1.0.0.0.0	352979	335976
В. Печалба преди облагане с данъци	OD.1.3.0.0.0.0	0	0	В. Загуба преди облагане с данъци	OD.2.2.0.0.0.0	100677	20612
III. Разходи за данъци	OD.1.4.0.0.0.0						
Г. Нетна печалба за периода (В-III)	OD.1.5.0.0.0.0	0	0	Г. Нетна загуба за периода	OD.2.3.0.0.0.0	100677	20612
ВСИЧКО (Б+III+Г)	OD.1.6.0.0.0.0	453656	356588	ВСИЧКО (Б+Г)	OD.2.4.0.0.0.0	453656	356588

ОТЧЕТ ЗА ПАРИЧНИТЕ ПОТОЦИ ПО ПРЕКИЯ МЕТОД

на ДФ АДФА СОФИХ ИНДЕКС
за периода 01.01.2020 - 30.06.2020

Дата: 17.7.2020 г.

Съставител: Силаска Спасова-Димова
Ръководител: ИВАН НЕНКОВ, МАЯ ЯНКОВА, ЛЮБОМИР ЕВСТАТИЕВ

(в тълк.)

Наименование на паричните потоци	Код	Текущ период			Предходен период		
		Постъпления	Платания	Нетен поток	Постъпления	Платания	Нетен поток
а	б	1	2	3	4	5	6
А. Парични потоци от оперативна дейност							
1. Парични потоци, свързани с емитиране и обратното изкупуване на акции/ дялове	OPR 1.1.0.0.0	6000	-32107	-26107	2000	-195906	-193906
2. Парични потоци, свързани с получени заем. в т.ч.	OPR 1.2.0.0.0			0			0
лихви	OPR 1.2.1.0.0			0			0
3. Платания при разпределяния на печалби	OPR 1.3.0.0.0			0			0
4. Парични потоци, свързани с валутни операции	OPR 1.4.0.0.0			0			0
5. Други парични потоци от оперативна дейност	OPR 1.5.0.0.0			0			0
Всичко парични потоци от оперативна дейност (А):	OPR 1.0.0.0.0	6000	-32107	-26107	2000	-195906	-193906
Б. Парични потоци от инвестиционна дейност							
1. Парични потоци, свързани с текущи финансови активи	OPR 2.1.0.0.0	77211	-71039	6171	148256	-171603	-23347
2. Парични потоци, свързани с текущи финансови активи	OPR 2.2.0.0.0			0			0
3. Лихви, комисиони и др. подобни	OPR 2.3.0.0.0	15	-720	-705	104	-1040	-936
4. Получени дивиденди	OPR 2.4.0.0.0	1222		1222			0
5. Парични потоци, свързани с управлявано дружество	OPR 2.5.0.0.0		-2488	-2488		-4189	-4189
6. Парични потоци, свързани с банка-депозитор	OPR 2.6.0.0.0		-2024	-2024		-2677	-2677
7. Парични потоци, свързани с валутни операции	OPR 2.7.0.0.0			0			0
8. Други парични потоци от инвестиционна дейност	OPR 2.8.0.0.0			0			0
Всичко парични потоци от инвестиционна дейност (Б):	OPR 2.0.0.0.0	78447	-76271	2176	148360	-179510	-31149
В. Парични потоци от финансиране дейност							
1. Парични потоци, свързани с други контрагенти	OPR 3.1.0.0.0		-2996	-2996		-2699	-2699
2. Парични потоци, свързани с текущи активи	OPR 3.2.0.0.0			0			0
3. Парични потоци, свързани с възвратък: ления	OPR 3.3.0.0.0			0			0
4. Парични потоци, свързани с данъци	OPR 3.4.0.0.0			0			0
5. Други парични потоци от финансиране дейност	OPR 3.5.0.0.0			0			0
Всичко парични потоци от финансиране дейност (В):	OPR 3.0.0.0.0	0	-2996	-2996	0	-2699	-2699
Г. Изменение на паричните средства през периода (А+Б+В)	OPR 4.0.0.0.0	84447	-111374	-26927	150360	-378115	-227755
Д. Парични средства и парични еквиваленти в началото на периода	OPR 5.0.0.0.0			53318			249033
Е. Парични средства и парични еквиваленти в края на периода, в т.ч.:	OPR 6.0.0.0.0			26390			21278
по безкочни депозити	OPR 6.1.0.0.0			26390			21278

Забелешка: Платанията в колонии 2 и 5 да се представят с отрицателен знак!

ОТЧЕТ ЗА ИЗМЕНЕНИЯ В СОБСТВЕННЫЙ КАПИТАЛ
на ДФ АДФА SOFEX ИНДЕКС
за периода 01.01.2020 - 30.06.2020

Дата: 17.7.2020 г.

Составитель: Спасска Спассова-Димова
Рыководитель: ИВАН НЕНКОВ, МАЯ ЯНКОЕ
(с.лещ)

ПОКАЗАТЕЛИ	Код	Основной капитал	Резервы			Нагружены печатями/загуби		Общий собственный капитал
			проемы от списания (проемы резервы)	резервы от поставших оценок	общий резервы	печатля	загуба	
а	б	1	2	3	4	5	6	7
Салдо към началото на предходния отчетен период	OSK 2 000 000							0
Салдо в началото на отчетния период	OSK 3 000 000	1038474	2083429	0	0	0	-2577130	544774
Проемы в началните салда по ред:	OSK 4 000 000	0	0	0	0	0	0	0
- ефект от промени в счетоводната политика	OSK 4 110 000							0
- корекция на грешки от минали периоди	OSK 4 120 000							0
Коригирано салдо в началото на отчетния период	OSK 5 000 000	1038474	2083429	0	0	0	-2577130	544774
Изменение за сметка на собствените, в т.ч.:	OSK 6 000 000	-53671	27468	0	0	0	0	-26203
- списване	OSK 6 110 000	11128	-5142					5986
- обратно изкупуване	OSK 6 120 000	-64799	32610					-32189
Нетна печатля/загуба за периода	OSK 7 000 000					0	-100677	-100677
1. Разпределение на печатлята за:	OSK 7 100 000	0	0	0	0	0	0	0
- дивиденди	OSK 7 110 000							0
- други	OSK 7 120 000							0
2. Покриване на загуби	OSK 7 200 000							0
3. Последващи оценки на дълготрайни материали и нематериални активи, в т.ч.:	OSK 7 300 000	0	0	0	0	0	0	0
а) увеличения	OSK 7 310 000							0
б) намалявания	OSK 7 320 000							0
4. Последващи оценки на финансови активи и инструменти, в т.ч.:	OSK 7 400 000	0	0	0	0	0	0	0
а) увеличения	OSK 7 410 000							0
б) намалявания	OSK 7 420 000							0
5. Други изменения	OSK 7 500 000							0
Салдо към края на отчетния период	OSK 7 000 000	984803	2110898	0	0	0	-2677807	417894
6. Други промени	OSK 8 000 000							0
Собствен капитал към края на отчетния период	OSK 9 000 000	984803	2110898	0	0	0	-2677807	417894

ДОПЪЛНИТЕЛНА ИНФОРМАЦИЯ ПО ЧЛ. 73, АЛ. 1 ОТ НАРЕДБА № 44
на ДФ АЛФА SOFTIX ИНДЕКС
за периода 01.01.2020 - 30.06.2020

Справка № 5 КИС - Доп. информация

Дата: 17.7.2020 г.
 Съставител: Спаска Спасова-Димова
 Ръководител: ИВАН НЕНКОВ, МАЯ Я

Номер по ред	ПОКАЗАТЕЛИ	Код	Стойност
1	2	3	4
1	Валута, в която са емитирани дяловете	DI.1.0.0.0.1	BGN
2	Брой дялове в началото на отчетния период	DI.1.0.0.0.2	1038474.0175
3	Брой дялове към края на отчетния период	DI.1.0.0.0.3	984802.7502
4	Брой емитирани дялове през отчетния период	DI.1.0.0.0.4	11127.5964
5	Стойност на емитираните дялове през отчетния период (в лева)	DI.1.0.0.0.5	6000.0000 лв.
6	Брой обратно изкупени дялове през отчетния период	DI.1.0.0.0.6	64798.8637
7	Стойност на обратно изкупените дялове през отчетния период (в лева)	DI.1.0.0.0.7	32107.0000 лв.
8	Нетна стойност на активите на един дял в началото на отчетния период (в съответната валута)	DI.1.0.0.0.8	0.5246
9	Нетна стойност на активите на един дял към края на отчетния период (в съответната валута)	DI.1.0.0.0.9	0.4243
10	Разходи/такси за управление към УД (в лева)	DI.1.0.0.0.10	2389.22 лв.
11	Разходи/такси към депозитара (в лева)	DI.1.0.0.0.11	2021.34 лв.
12	Разходи/такси към инвестиционни посредници, свързани със сделки с активи от портфейла (в лева)	DI.1.0.0.0.12	703.03 лв.
13	Доходност от началото на годината (в %)	DI.1.0.0.0.13	-18.45%
14	Доходност от датата на публичното предлагане (в %)	DI.1.0.0.0.14	-5.99%
15	Доходност за последните 12 месеца (в %)	DI.1.0.0.0.15	-21.99%
16	Стандартно отклонение (в %)	DI.1.0.0.0.16	22.90%

ИНФОРМАЦИЯ ПО ЧЛ. 73 , ал. 1, т. 5, букви А-Д ОТ НАРЕДБА 44 НА КФН

ЗА ДФ "АЛФА SOFIX ИНДЕКС" КЪМ 30.06.2020 г.

А) Брой дялове в обръщение към края на периода, брой емитирани и обратно изкупени дялове:

	01.01.2020-30.06.2020
Брой дялове в началото на периода	1 038 474.0175 броя
Брой емитирани дялове	11 127.5964 броя
Брой обратно изкупени дялове	64 798.8637 броя
Брой дялове в обръщение към края на периода	984 802.7502 броя

Б) Нетна стойност на активите и нетна стойност на активите на един дял по последен портфейл

Стойност на нетните активи по последен портфейл от 30.06.2020 г.	Нетна стойност на активите на един дял по последен портфейл от 30.06.2020 г.
417 893.52 лв.	0.4243 лв.

В) Структура на инвестициите на ДФ АЛФА SOFIX ИНДЕКС

АКТИВИ	30.06.2020	
Акции и права	387 609.36 лв.	92.59 %
Парични средства	26 390.22 лв.	6.30%
Вземания от дивиденди и права	4 628.91 лв.	1.11
Общо активи	418 628.49 лв.	100.00%
Задължения	734.97 лв.	-
НЕТНА СТОЙНОСТ НА АКТИВИТЕ	417 893.52 лв.	-

Отраслова структура на инвестициите на ДФ АЛФА SOFIX ИНДЕКС

Име	Стойност	Дял от активите на КИС
Холдинги	86 497.69 лв.	20.66%
Здравеопазване	74 409.30 лв.	17.77%
Недвижими имоти	82 888.40 лв.	19.80%
Индустриални и потребителски стоки и материали	33 028.25 лв.	7.89%
Банки и застрахователни компании	46 897.12 лв.	11.20%
Туризм	22 715.00 лв.	5.43%
Бизнес услуги	41 173.60 лв.	9.84%
ОБЩО	387 609.36 лв.	92.59%
ОБЩО АКТИВИ	418 628.49 лв.	
НЕТНА СТОЙНОСТ НА АКТИВИТЕ	417 893.52 лв.	

Г) Промени в състава на портфейла

Емитент	ISIN код	30.06.2020			сделки през периода (нето)	31.12.2019		
		Брой	Стойност (лв.)	Дял		Брой	Стойност (лв.)	Дял от активите
Адванс Терафонд АДСИЦ-София	BG1100025052	28 518	52 758.30	12.60%	2 000	26 518	46 539.09	8.53%
Албена АД-к.к. Албена	BG11ALBAAT17	770	22 715.00	5.43%	50	720	30 096.00	5.52%
Доверие обединен Холдинг АД-София	BG1100038980	6 390	20 032.65	4.79%	200	6 190	26 369.40	4.83%
Еврохолд България АД-София	BG1100114062	-	-	-	(31 064)	31 064	54 672.64	10.02%
Индустриален Холдинг България АД-София	BG1100019980	24 804	18 851.04	4.50%	(5000)	29 804	30 102.04	5.52%
М+С Хидравлик	BG11MPKAAT18	3 473	21 706.25	5.18%	3 473	-	-	-
Монбат АД-София	BG1100075065	3 700	11 322.00	2.70%	-	3 700	23 865.00	4.37%
ТБ Първа Инвестиционна Банка АД-София	BG1100106050	7 684	19 440.52	4.64%	(500)	8 184	28 562.16	5.24%
Сирма Груп Холдинг АД	BG1100032140	-	-	-	(10 409)	10 409	6 479.60	1.19%
Софарма АД-София	BG11SOSOBT18	23 436	74 409.30	17.77%	(998)	24 434	82 709.09	15.16%
Стара планина Холд АД-София	BG1100005971	2 900	12 876.00	3.08%	2 900	-	-	-
Фонд за недвижими имоти България АДСИЦ-София	BG1100001053	16 555	30 130.10	7.20%	1 500	15 055	29 658.35	5.44%
Химимпорт АД-София	BG1100046066	39 590	41 173.60	9.84%	4 000	3 5590	56 232.20	10.31%
ТБ Централна кооперативна банка	BG1100014973	13 990	14 549.60	3.48%	1 700	12 290	18 803.70	3.45%
Елана Агрокредит АД-София	BG1100040101	12 907	12 907.00	3.08%	-	12 907	14 584.91	2.67%
Холдинг Варна АД-Варна	BG1100036984	73	2 832.40	0.68%	-	73	2 927.30	0.54%
Градус АД-Стара Загора	BG1100002184	22 080	31 905.60	7.62%	(1 475)	23 555	39 454.63	7.23%
Общо		387 609.36 лв.	92.59%			491 056.11 лв.	90.00%	
Обща стойност на активите		418 628.49 лв.	-			545 595.45 лв.	-	
Нетна стойност на активите		417 893.52 лв.	-			544 773.77 лв.	-	

От 01 февруари 2014 г. портфейлът на Алфа SOFIX Индекс репликира борсовия индекс SOFIX. В портфейла са включени позициите, влизащи в индекса SOFIX със съответните им тегла в индекса.

Извършваните през периода сделки са единствено с цел максимално близко следване на индекса при спазване на всички инвестиционни ограничения, заложи в нормативната уредба и правилата на Фонда.

Съгласно инвестиционната стратегия на Фонда, промени в компаниите, влизащи в портфейла на фонда се правят при промени на състава на индекса SOFIX.

Д) Информация по чл. 73, ал. 1, т. 5, б. Д

Приходи от инвестиционни сделки

Приходи	Стойност
	01.01.2020 г.- 30.06.2020 г.
Приходи от преоценка на финансови активи и инструменти	341 771 лв.
Приходи от лихви по разплащателни сметки	15 лв.
Приходи от операции с финансови инструменти	6 573 лв.
Приходи от съучастия	4 620 лв.
Общо приходи:	352 979 лв.

Разходи за периода

Разходи	Стойност
	01.01.2020 – 30.06.2020 г.
Разходи по преоценка на финансови активи и инструменти	444 866 лв.
Възнаграждение на Управляващо дружество	2 293 лв.
Разходи по операции с финансови инструменти	745 лв.
Възнаграждение на банката депозитар	2 021 лв.
Други външни услуги- КФН, одит, ЦД и др.	2 996 лв.
Други финансови разходи	734 лв.
Общо разходи	453 656 лв.

Сума на активите

Сума на активите	Сума на активите	Сума на активите	Сума на активите	Сума на активите	Сума на активите
31.01.2020 г.	29.02.2020 г.	31.03.2020 г.	30.04.2020 г.	31.05.2020 г.	30.06.2020 г.
548 551.44 лв.	529 739.99 лв.	396 326.83 лв.	419 508.95 лв.	420 072.28 лв.	418 628.49 лв.

През отчетния период няма разкрита вътрешна информация.

Няма задължения възникнали от сделки с деривативни инструменти по чл. 38, ал. 1, т. 7 и 8 от ЗДКИСДПКИ.