

**ИНФОРМАЦИЯ**  
**СЪГЛАСНО ЧЛ. 72 ОТ НАРЕДБА № 44 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ**  
**ДЕЙНОСТТА НА КИС, ИД ОТ ЗАТВОРЕН ТИП И УД**

**ДФ ДИ ВИ КОМФОРТ**

Съгласно инвестиционната политика и стратегия на Фонда за инвестиране предимно в облигации, търгувани на регулираните пазари в страната и чужбина и при разрешена експозиция в акции до 20% от размера на активите през периода няма закупени и продадени ценни книжа.

Към 31.03.2016 г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ди Ви Комфорт са разпределени в 2 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 29.02.2016 г. възлиза на 4.41%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 24.95% от активите на ДФ Ди Ви Комфорт.

Към 31.03.2016 г. корпоративните облигации представляват 11.51% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Комфорт, а общинските - 1.52% от стойността на активите.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.03.2016 г. са 36.91% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, вземания от дивиденди и вземане по договор възлизат на 20.70% от активите на Фонда.

Към 31.03.2016 г. ДФ Ди Ви Комфорт е в процедура по вливането му в ДФ Ди Ви Хармония, на основание Решение № 110 – ДФ от 22.02.2016 г. на КФН. На 31.03.2016 г. нетната стойност на активите на ДФ Ди Ви Комфорт е 655 960 лв.

**I. Данни по чл. 72, ал. 2 от Наредба № 44**

**1. Данни по чл. 72, ал. 2, т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти**

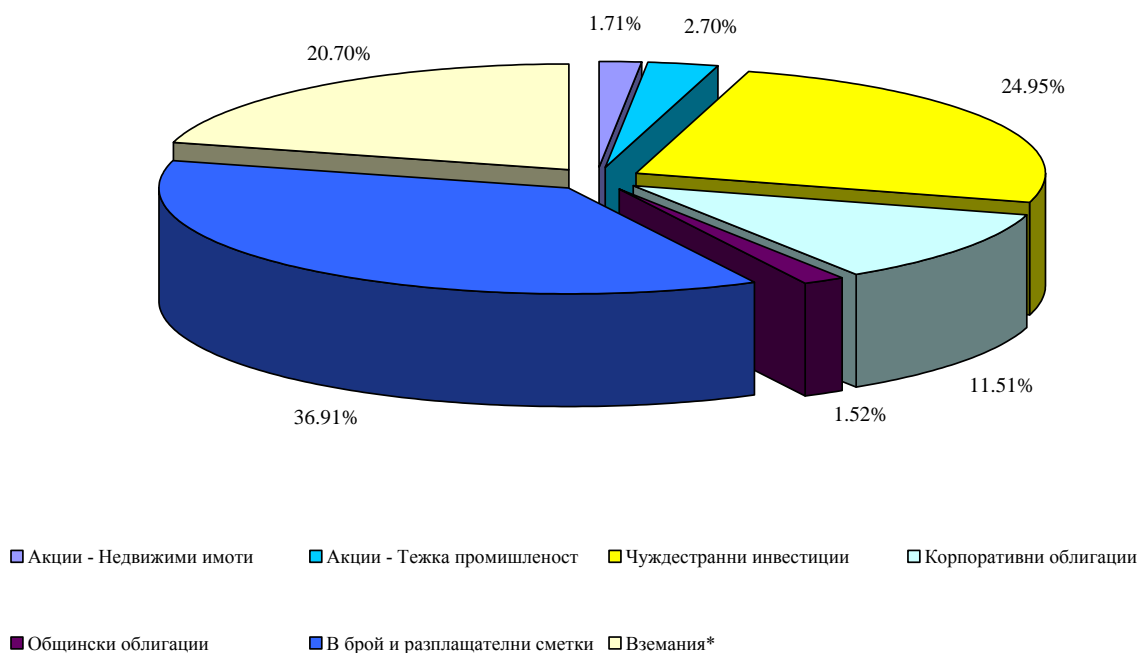
Структурата на портфейла на ДФ Ди Ви Комфорт към 31.03.2016 г. е представена в следната таблица и графика.



Структура на портфейла на ДФ Ди Ви Комфорт към 31.03.2016 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Недвижими имоти	11 219	1.71%
Акции - Тежка промишленост	17 742	2.70%
Чуждестранни инвестиции	163 989	24.95%
Корпоративни облигации	75 661	11.51%
Общински облигации	9 980	1.52%
В брой и разплащателни сметки	242 606	36.91%
Вземания*	136 023	20.70%
Общо активи	657 220	100.00%

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

Разпределение на активите на Ди Ви Комфорт към 31/03/2016



**2. Данни по чл. 72, ал. 2, т. 2: Видове деривативни инструменти, основни рискове, свързани с базовите активи на деривативните инструменти, количествени ограничения и избрани методи за оценка на риска, свързан със сделките 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.

<b>Рисков актив</b>				
<b>ISIN</b>	<b>Валута</b>	<b>Брой</b>	<b>Цена</b>	<b>Обща Стойност</b>
Валутно деноминиран актив	USD	1 351.91	1.000	\$1 351.91
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	205.520	\$9 453.92
Валутно деноминиран актив	USD	188.00	118.820	\$22 338.16
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	109.200	\$6 661.20

<b>Обща рискова позиция</b>	\$39 805.19
-----------------------------	-------------

<b>Деривативен инструмент</b>						
<b>Вид</b>	<b>Валута</b>	<b>Брой</b>	<b>Цена</b>	<b>Обща Стойност</b>	<b>Пазар</b>	<b>Държава</b>
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 36 000.00	1.097580	\$39 512.88	OTC	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>				\$39 512.88		

Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД