



**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 акции и облигации. Падежирала е корпоративна облигация.

Към 30.11.2015г. 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 30.11.2015г. възлиза на 4.30%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 26.12% от активите на ДФ Ди Ви Комфорт.

Към 30.11.2015г. корпоративните облигации представляват 19.86% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Комфорт, а общинските - 1.69% от стойността на активите.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.11.2015г. са 27.95% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, вземане по договор и платена такса КФН възлизат на 20.08% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.11.2015г. е 2.37% на годишна база*. Доходността от началото на годината е минус 10.40%, а доходността за последните 12 месеца към 30.11.2015г. е минус 12.02%.

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

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 30.11.2015г. е представена в следната таблица и графика.

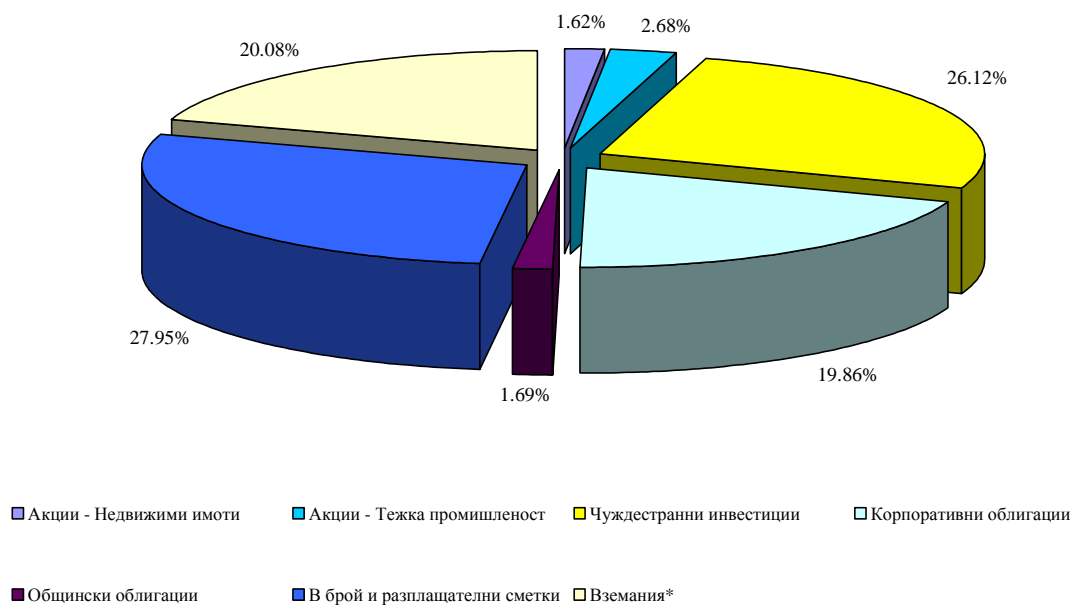
* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.



Структура на портфейла на ДФ Ди Ви Комфорт към 30.11.2015 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Недвижими имоти	10 765	1.62%
Акции - Тежка промишленост	17 799	2.68%
Чуждестранни инвестиции	173 094	26.12%
Корпоративни облигации	131 663	19.86%
Общински облигации	11 215	1.69%
В брой и разплащателни сметки	185 314	27.95%
Вземания*	133 105	20.08%
Общо активи	662 955	100.00%

* Вземания във връзка с главница и лихва по облигационни емисии, платена такса към КФН и вземания по договор.

Разпределение на активите на Ди Ви Комфорт към 30/11/2015



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.

Рисков актив				
ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
Валутно деноминиран актив	USD	1 137.07	1.000	\$1 137.07
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	208.690	\$9 599.74
Валутно деноминиран актив	USD	188.00	115.910	\$21 791.08
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	114.020	\$6 955.22

Обща рискова позиция	\$39 483.11
-----------------------------	-------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 36 000.00	1.075550	\$38 719.80	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$38 719.80		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД