



**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 са продадени акции и корпоративни облигации.

Към 31.08.2015г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ди Ви Комфорт са разпределени в 3 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 31.08.2015г. възлиза на 6.64%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 25.51% от активите на ДФ Ди Ви Комфорт.

Към 31.08.2015г. корпоративните облигации представляват 23.15% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Комфорт, а общинските - 1.73% от стойността на активите.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.08.2015г. са 17.30% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, хеджиране, вземане по договор, начислени дивиденди и платена такса КФН възлизат на 25.67% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.08.2015г. е 2.79% на годишна база*. Доходността от началото на годината е минус 7.36%, а доходността за последните 12 месеца към 31.08.2015г. е минус 12.42%.

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 31.08.2015г. е представена в следната таблица и графика.

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

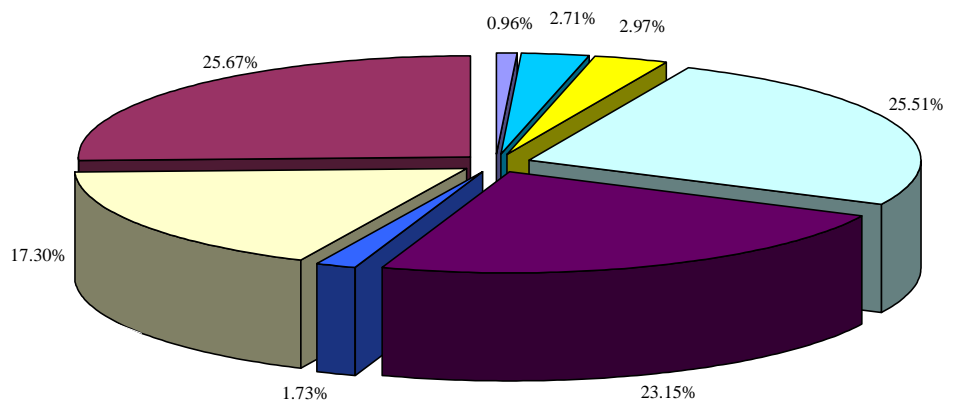


Структура на портфейла на ДФ Ди Ви Комфорт към 31.08.2015 г.

Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Фармацевтична промишленост	6 105	0.96%
Акции - Недвижими имоти	17 247	2.71%
Акции - Тежка промишленост	18 893	2.97%
Чуждестранни инвестиции	162 369	25.51%
Корпоративни облигации	147 346	23.15%
Общински облигации	11 023	1.73%
В брой и разплащателни сметки	110 065	17.30%
Вземания*	163 339	25.67%
Общо активи	636 387	100.00%

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

Разпределение на активите на Ди Ви Комфорт към 31/08/2015



- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Недвижими имоти
- Акции - Тежка промишленост
- Чуждестранни инвестиции
- Корпоративни облигации
- Общински облигации
- В брой и разплащателни сметки
- Вземания*



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	971.16	1.000	\$971.16
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	197.670	\$9 092.82
Валутно деноминиран актив	USD	188.00	115.060	\$21 631.28
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	104.310	\$6 362.91
Обща рискова позиция				\$38 058.17

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 36 000.00	1.110250	\$39 969.00	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$39 969.00		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД