



**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.

Към 30.09.2015г. 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 30.09.2015г. възлиза на 5.66%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 23.49% от активите на ДФ Ди Ви Комфорт.

Към 30.09.2015г. корпоративните облигации представляват 21.67% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Комфорт, а общинските - 1.62% от стойността на активите.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.09.2015г. са 23.79% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, вземане по договор, начислени дивиденди и платена такса КФН възлизат на 23.77% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.09.2015г. е 2.72% на годишна база*. Доходността от началото на годината е минус 7.75%, а доходността за последните 12 месеца към 30.09.2015г. е минус 12.57%.

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 30.09.2015г. е представена в следната таблица и графика.

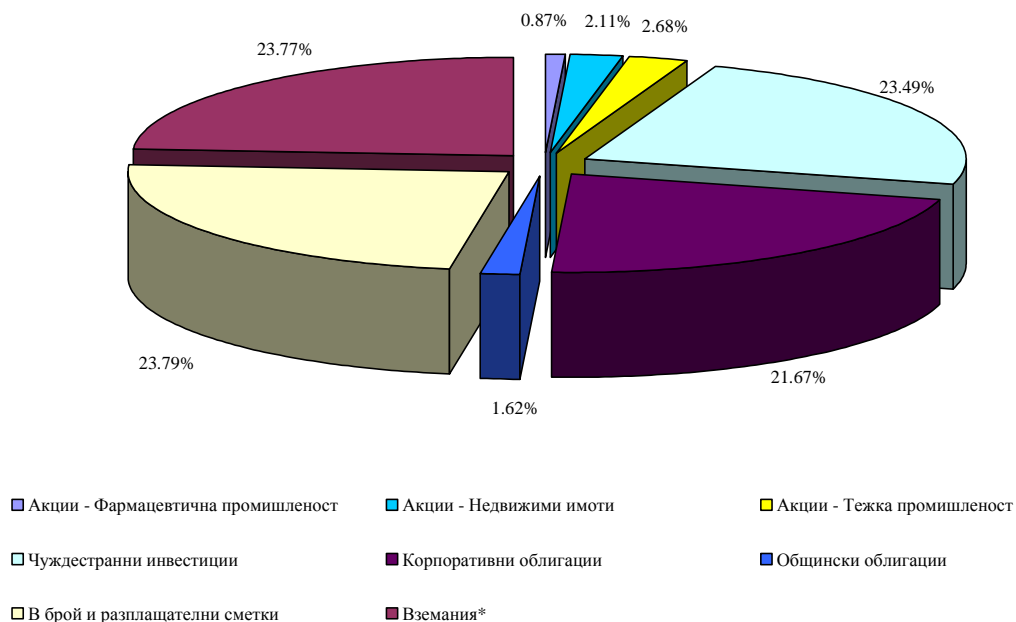
* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.



Структура на портфейла на ДФ Ди Ви Комфорт към 30.09.2015 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Фармацевтична промишленост	5 922	0.87%
Акции - Недвижими имоти	14 378	2.11%
Акции - Тежка промишленост	18 271	2.68%
Чуждестранни инвестиции	160 315	23.49%
Корпоративни облигации	147 831	21.67%
Общински облигации	11 086	1.62%
В брой и разплащателни сметки	162 327	23.79%
Вземания*	162 189	23.77%
Общо активи	682 319	100.00%

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

Разпределение на активите на Ди Ви Комфорт към 30/09/2015



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	1 011.85	1.000	\$1 011.85
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	191.630	\$8 814.98
Валутно деноминиран актив	USD	188.00	116.090	\$21 824.92
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	101.760	\$6 207.36
Обща рискова позиция				\$37 859.11

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 36 000.00	1.130670	\$40 704.12	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$40 704.12		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД