

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.

Към 31.12.2015г. 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 31.12.2015г. възлиза на 4.26%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 23.32% от активите на ДФ Ди Ви Комфорт.

Към 31.12.2015г. корпоративните облигации представляват 18.38% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Комфорт, а общинските - 1.37% от стойността на активите.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.12.2015г. са 34.04% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, вземания от дивиденди и вземане по договор възлизат на 18.63% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.12.2015г. е 2.34% на годишна база*. Доходността от началото на годината и доходността за последните 12 месеца към 30.12.2015г. е минус 10.57%.

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 31.12.2015г. е представена в следната таблица и графика.

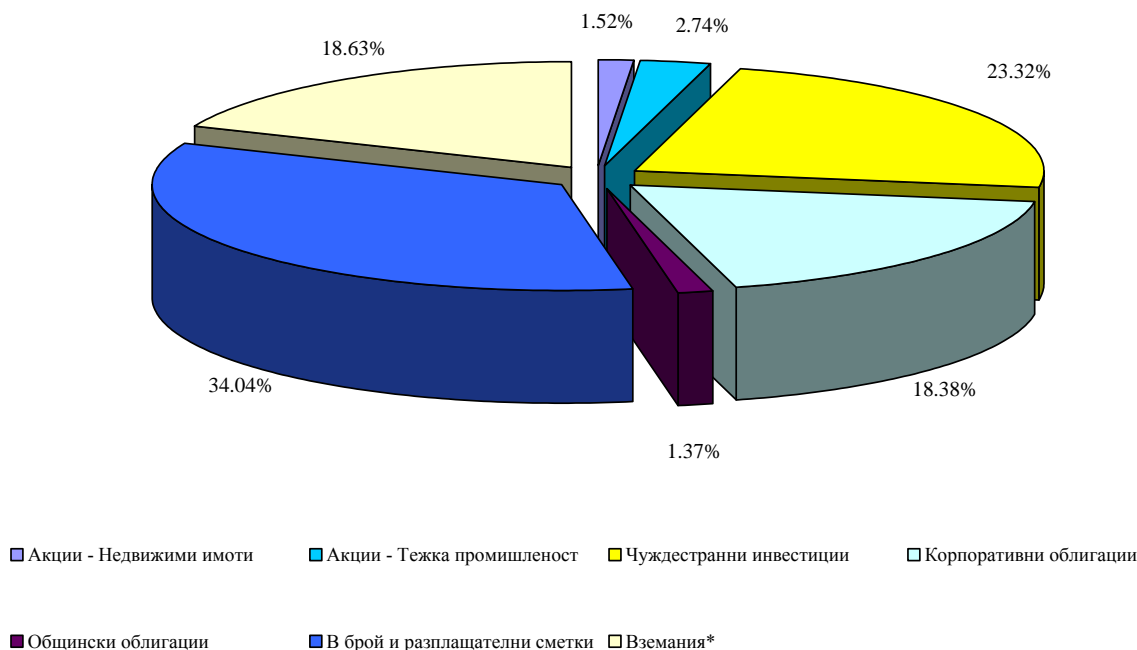
* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.



Структура на портфейла на ДФ Ди Ви Комфорт към 31.12.2015 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Недвижими имоти	10 883	1.52%
Акции - Тежка промишленост	19 572	2.74%
Чуждестранни инвестиции	166 815	23.32%
Корпоративни облигации	131 469	18.38%
Общински облигации	9 811	1.37%
В брой и разплащателни сметки	243 527	34.04%
Вземания*	133 239	18.63%
Общо активи	715 316	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 31/12/2015



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	1 177.21	1.000	\$1 177.21
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	205.930	\$9 472.78
Валутно деноминиран актив	USD	188.00	113.820	\$21 398.16
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	113.270	\$6 909.47

Обща рискова позиция	\$38 957.62
-----------------------------	-------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 36 000.00	1.096280	\$39 466.08	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$39 466.08		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД