



**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 29.02.2016 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 4.44%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 24.83% от активите на ДФ Ди Ви Комфорт.

Към 29.02.2016 г. корпоративните облигации представляват 11.64% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Комфорт, а общинските - 1.51% от стойността на активите.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 29.02.2016 г. са 37.21% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии и вземане по договор възлизат на 20.37% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.02.2016 г. е 2.21% на годишна база*. Доходността от началото на годината е минус 0.88%, а доходността за последните 12 месеца към 29.02.2016 г. е минус 11.85%.

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 29.02.2016 г. е представена в следната таблица и графика.

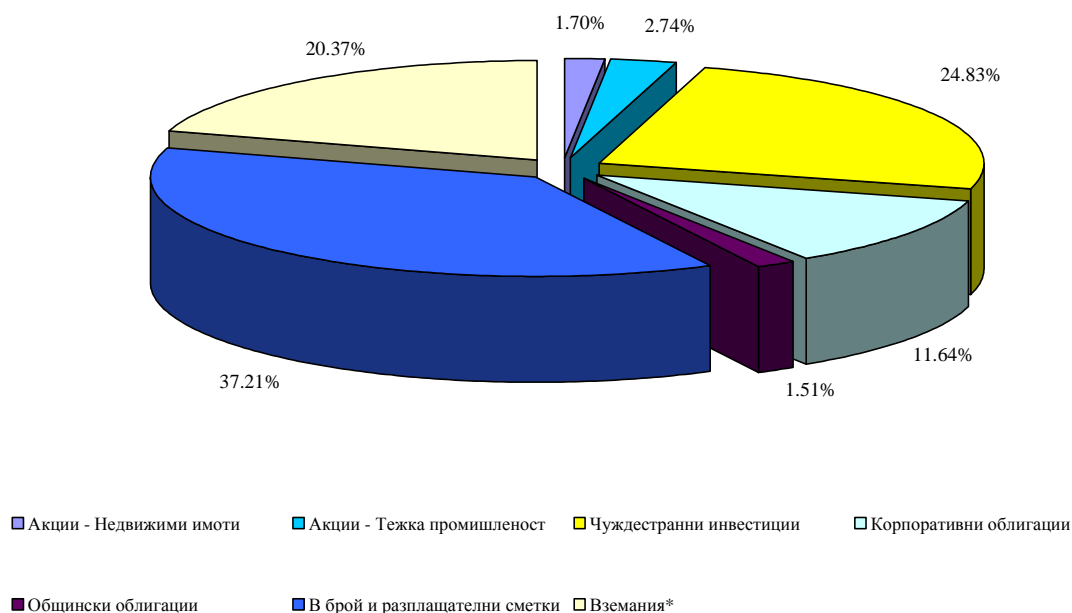
* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.



Структура на портфейла на ДФ Ди Ви Комфорт към 29.02.2016 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Недвижими имоти	11 117	1.70%
Акции - Тежка промишленост	17 972	2.74%
Чуждестранни инвестиции	162 642	24.83%
Корпоративни облигации	76 217	11.64%
Общински облигации	9 922	1.51%
В брой и разплащателни сметки	243 704	37.21%
Вземания*	133 442	20.37%
Общо активи	655 016	100.00%

* Вземания във връзка с главница и лихва по облигационни емисии и вземания по договор.

Разпределение на активите на Ди Ви Комфорт към 29/02/2016



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.

Рисков актив				
ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
Валутно деноминиран актив	USD	1 311.08	1.000	\$1 311.08
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	193.560	\$8 903.76
Валутно деноминиран актив	USD	188.00	115.010	\$21 621.88
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	102.500	\$6 252.50

Обща рискова позиция	\$38 089.22
-----------------------------	-------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 36 000.00	1.129500	\$40 662.00	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$40 662.00		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД