



**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 или продадени ценни книжа и финансови инструменти.

Към 31.07.2015г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ди Ви Комфорт са разпределени в 4 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 31.07.2015г. възлиза на 8.47%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 25.86% от активите на ДФ Ди Ви Комфорт.

Към 31.07.2015г. корпоративните облигации представляват 23.81% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Комфорт, а общинските - 1.66% от стойността на активите.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.07.2015г. са 13.04% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, вземане по договор, начислени дивиденди и платена такса КФН възлизат на 27.16% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.07.2015г. е 3.21% на годишна база\*. Доходността от началото на годината е минус 3.86%, а доходността за последните 12 месеца към 31.07.2015г. е минус 8.82%.

**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 31.07.2015г. е представена в следната таблица и графика.

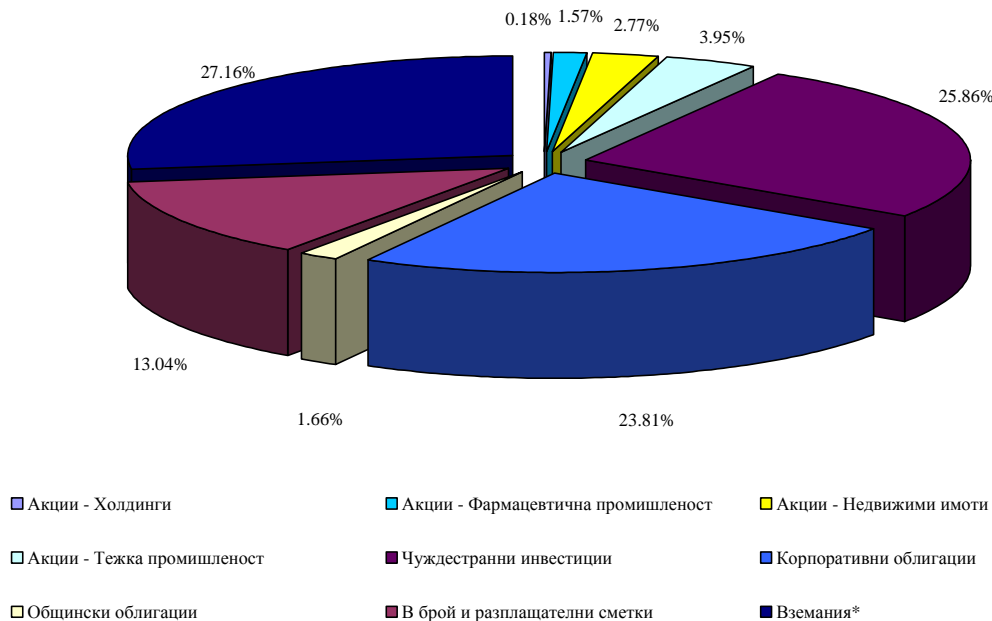
\* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.



Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.07.2015 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	1 190	0.18%
Акции - Фармацевтична промишленост	10 390	1.57%
Акции - Недвижими имоти	18 296	2.77%
Акции - Тежка промишленост	26 066	3.95%
Чуждестранни инвестиции	170 769	25.86%
Корпоративни облигации	157 235	23.81%
Общински облигации	10 959	1.66%
В брой и разплащателни сметки	86 135	13.04%
Вземания*	179 326	27.16%
Общо активи	660 366	100.00%

\* Вземания във връзка с главница и лихва по облигационни емисии, платени такси към КФН, начислени дивиденди и вземания по договор.

Разпределение на активите на Ди Ви Комфорт към 31/07/2015





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.

<b>Рисков актив</b>				
<b>ISIN</b>	<b>Валута</b>	<b>Брой</b>	<b>Цена</b>	<b>Обща Стойност</b>
Валутно деноминиран актив	USD	931.09	1.000	\$931.09
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	210.500	\$9 683.00
Валутно деноминиран актив	USD	188.00	116.350	\$21 873.80
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	111.950	\$6 828.95
<b>Обща рискова позиция</b>				<b>\$39 316.84</b>

<b>Деривативен инструмент</b>						
<b>Вид</b>	<b>Валута</b>	<b>Брой</b>	<b>Цена</b>	<b>Обща Стойност</b>	<b>Пазар</b>	<b>Държава</b>
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 36 000.00	1.098200	\$39 535.20	OTC	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>				<b>\$39 535.20</b>		

Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД