



**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 има продадени акции.

Към 30.06.2015г. 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 30.06.2015г. възлиза на 8.77%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 25.09% от активите на ДФ Ди Ви Комфорт.

Към 30.06.2015г. корпоративните облигации представляват 23.91% от общата стойност на активите на ДФ Ди Ви Комфорт, а общинските - 1.65% от стойността на активите.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.06.2015г. са 13.27% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, вземане по договор, начислени дивиденди и платена такса КФН възлизат на 27.31% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.06.2015г. е 3.20% на годишна база*. Доходността от началото на годината е минус 4.26%, а доходността за последните 12 месеца към 30.06.2015г. е минус 9.10%.

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 30.06.2015г. 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 30.06.2015 г.

Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	1 193	0.18%
Акции - Фармацевтична промишленост	11 867	1.80%
Акции - Недвижими имоти	18 131	2.74%
Акции - Тежка промишленост	26 771	4.05%
Чуждестранни инвестиции	165 869	25.09%
Корпоративни облигации	158 037	23.91%
Общински облигации	10 922	1.65%
В брой и разплащателни сметки	87 682	13.27%
Вземания*	180 517	27.31%
Общо активи	660 989	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 30/06/2015



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	846.92	1.000	\$846.92
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	205.850	\$9 469.10
Валутно деноминиран актив	USD	188.00	115.720	\$21 755.36
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	107.070	\$6 531.27

Обща рискова позиция	\$38 602.65
-----------------------------	-------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 36 000.00	1.127800	\$40 600.80	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$40 600.80		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД