

**ИНФОРМАЦИЯ**  
**СЪГЛАСНО ЧЛ. 72 ОТ НАРЕДБА № 44 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ**  
**ДЕЙНОСТТА НА КИС, ИД ОТ ЗАТВОРЕН ТИП И УД**

**ДФ ТИ БИ АЙ 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 от български публични дружества, търгувани на БФБ – София АД.

Към 28.02.2014г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт са разпределени в 5 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 28.02.2014г. възлиза на 12.10%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 11.24% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 28.02.2014г. корпоративните облигации представляват 32.31% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 1.90% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 20.08% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 28.02.2014г. са 5.15% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, начислени дивиденди, вземания от хеджиране и платени такси към КФН възлизат на 17.22% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 28.02.2014г. е 5.03% на годишна база\*, доходността от началото на годината е 2.34%, а доходността за последните 12 месеца към 28.02.2014г. е 6.16%.

**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**

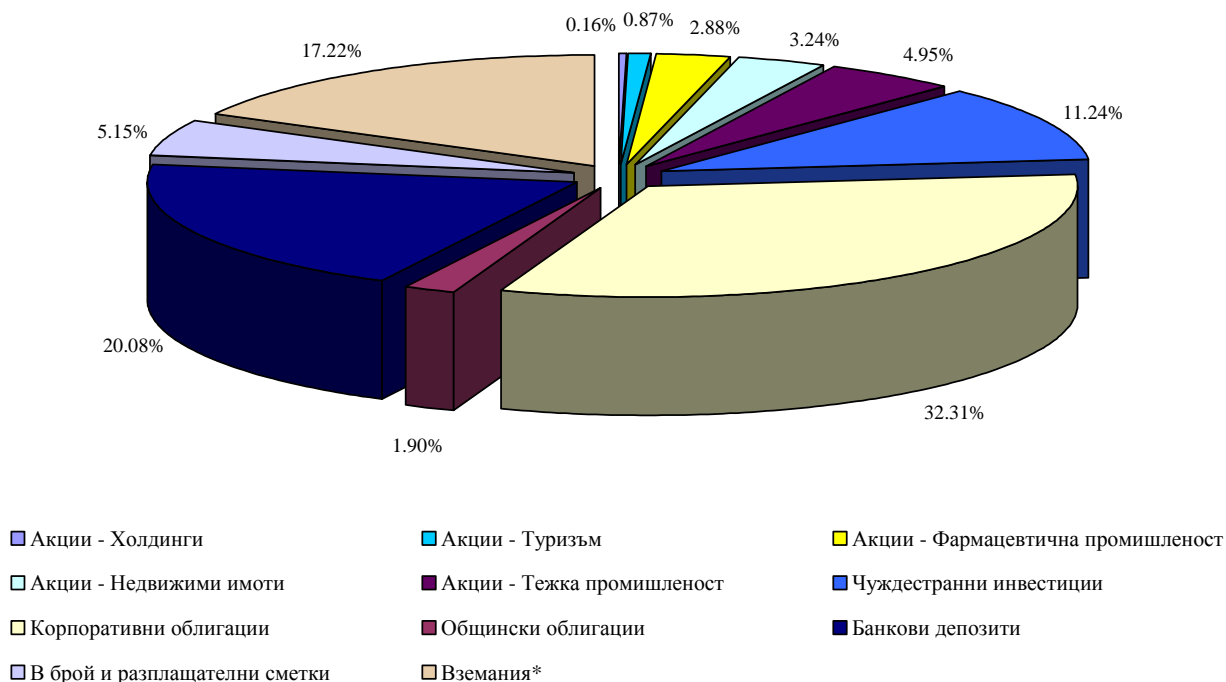
\* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 28.02.2014г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 28.02.2014 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	1 215	0.16%
Акции - Туризм	6 480	0.87%
Акции - Фармацевтична промишленост	21 485	2.88%
Акции - Недвижими имоти	24 141	3.24%
Акции - Тежка промишленост	36 997	4.95%
Чуждестранни инвестиции	83 985	11.24%
Корпоративни облигации	241 400	32.31%
Общински облигации	14 166	1.90%
Банкови депозити	149 955	20.08%
В брой и разплащателни сметки	38 470	5.15%
Вземания*	128 658	17.22%
<b>Общо активи</b>	<b>746 952</b>	<b>100.00%</b>

\* Вземания във връзка с начислени дивиденди, лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, платени такси КФН, вземания от хеджиране.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 28/02/2014



**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	304.06	1.000	\$304.06
Валутно деноминиран актив	USD	66.00	117.320	\$7 743.12
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	90.340	\$5 510.74
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	186.290	\$8 569.34

<b>Обща рискова позиция</b>	\$22 127.26
-----------------------------	-------------

<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	€ 15 600.00	1.375885	\$21 463.81	OTC	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>				\$21 463.81		

Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД