

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 закупени чуждестранни инвестиции.

Към 30.09.2014г. 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 30.09.2014г. възлиза на 10.46%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 17.44% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 30.09.2014г. корпоративните облигации представляват 24.19% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 1.78% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 18.61% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.09.2014г. са 5.29% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, начислени дивиденди и платени такси към КФН възлизат на 22.23% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.09.2014г. е 4.63% на годишна база*, доходността от началото на годината е 1.88%, а доходността за последните 12 месеца към 30.09.2014г. е 1.53%.

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

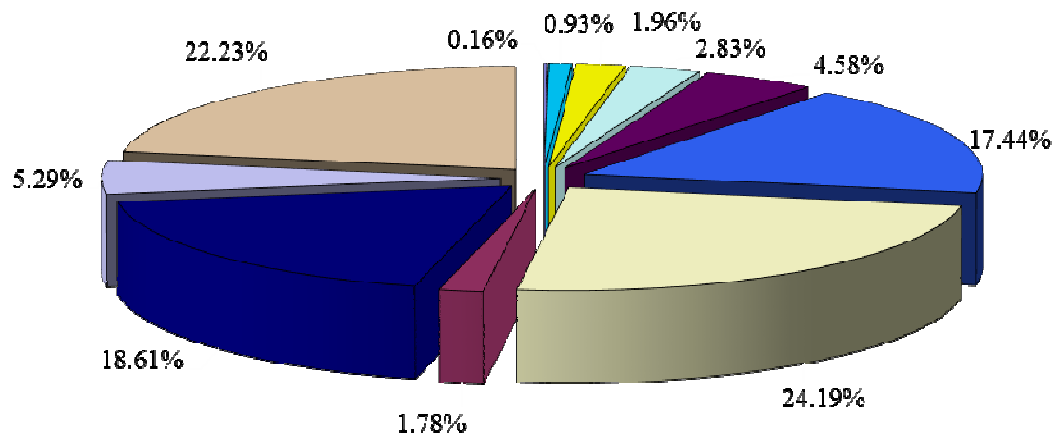
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 30.09.2014г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 30.09.2014 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
<i>Акции - Холдинги</i>	1 216	0.16%
<i>Акции - Туризм</i>	6 877	0.93%
<i>Акции - Фармацевтична промишленост</i>	14 572	1.96%
<i>Акции - Недвижими имоти</i>	21 079	2.83%
<i>Акции - Тежка промишленост</i>	34 040	4.58%
<i>Чуждестранни инвестиции</i>	129 726	17.44%
<i>Корпоративни облигации</i>	179 894	24.19%
<i>Общински облигации</i>	13 247	1.78%
<i>Банкови депозити</i>	138 404	18.61%
<i>В брой и разплащателни сметки</i>	39 369	5.29%
<i>Вземания*</i>	165 307	22.23%
<i>Общо активи</i>	743 731	100.00%

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

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към
30/09/2014**



- | | |
|--------------------------------------|---------------------------------|
| ■ Акции - Холдинги | ■ Акции - Туризм |
| ■ Акции - Фармацевтична промишленост | ■ Акции - Недвижими имоти |
| ■ Акции - Тежка промишленост | ■ Чуждестранни инвестиции |
| ■ Корпоративни облигации | ■ Общински облигации |
| ■ Банкови депозити | ■ В брой и разплащателни сметки |
| ■ Вземания* | |

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.

ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
Валутно деноминиран актив	USD	352.39	1.000	\$352.39
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	197.020	\$9 062.92
Валутно деноминиран актив	USD	188.00	118.220	\$22 225.36
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	98.790	\$6 026.19

Обща рискова позиция	\$37 666.86
-----------------------------	-------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 28 500.00	1.294290	\$36 887.27	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$36 887.27		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД