

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 има продадени акции.

Към 31.03.2015г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт са разпределени в 4 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 31.03.2015г. възлиза на 9.48%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 21.45% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 31.03.2015г. корпоративните облигации представляват 24.67% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 1.73% от стойността на активите.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.03.2015г. са 13.01% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, вземане по договор, начислени дивиденди, хеджиране и платена такса КФН възлизат на 29.66% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.03.2015г. е 3.86% на годишна база*. Доходността от началото на годината е 0.79%, а доходността за последните 12 месеца към 31.03.2015г. е минус 5.32%.

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

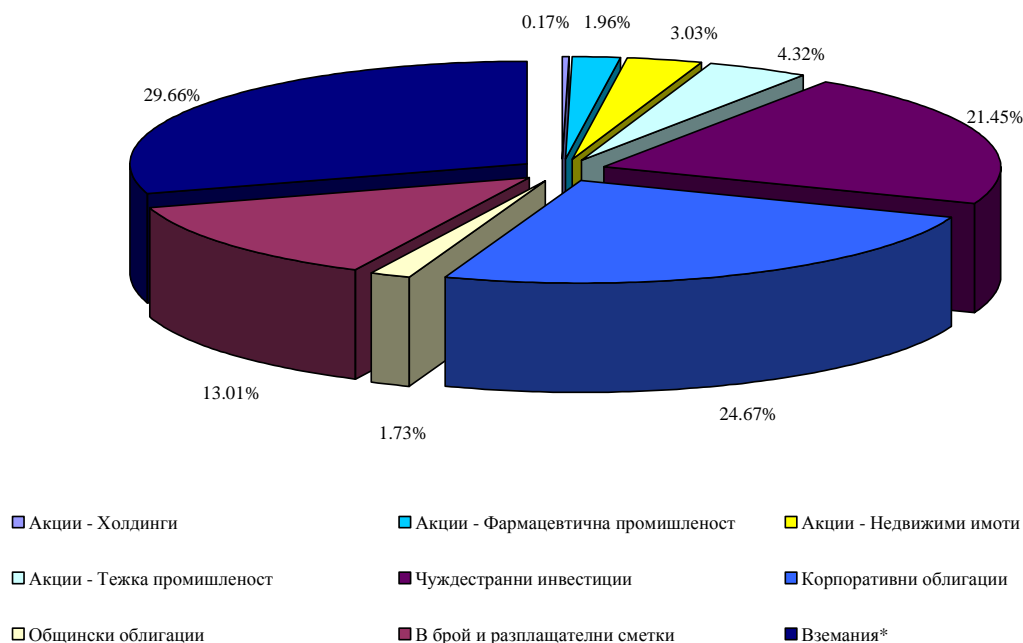
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.03.2015г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 31.03.2015 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	1 211	0.17%
Акции - Фармацевтична промишленост	13 686	1.96%
Акции - Недвижими имоти	21 189	3.03%
Акции - Тежка промишленост	30 146	4.32%
Чуждестранни инвестиции	149 763	21.45%
Корпоративни облигации	172 356	24.67%
Общински облигации	12 066	1.73%
В брой и разплащателни сметки	90 861	13.01%
Вземания*	207 149	29.66%
Общо активи	698 427	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 31/03/2015



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	686.23	1.000	\$686.23
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	206.430	\$9 495.78
Валутно деноминиран актив	USD	188.00	121.710	\$22 881.48
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	105.600	\$6 441.60
Обща рискова позиция				\$39 505.09

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 36 000.00	1.062510	\$38 250.36	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$38 250.36		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД