

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 31.01.2014г. 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 31.01.2014г. възлиза на 11.97%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 11.09% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 31.01.2014г. корпоративните облигации представляват 33.16% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 1.91% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 20.21% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.01.2014г. са 4.60% 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 17.06% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.01.2014г. е 4.89% на годишна база*, доходността от началото на годината е 0.91%, а доходността за последните 12 месеца към 31.01.2014г. е 4.75%.

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

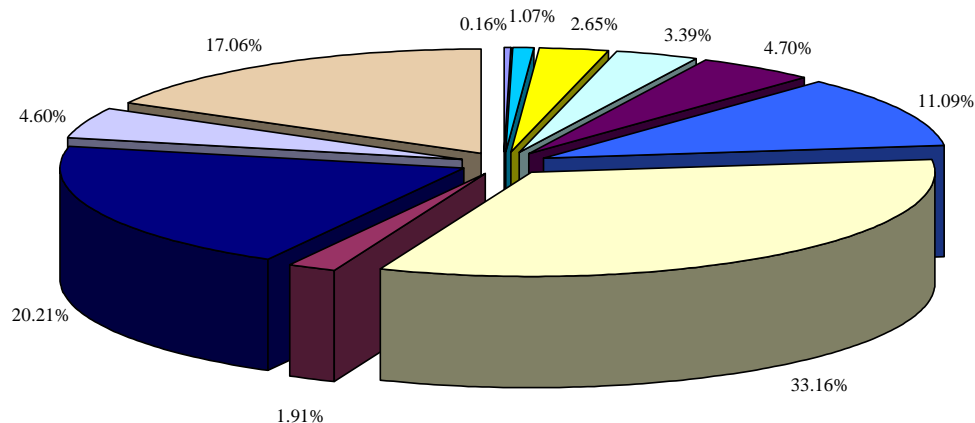
* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.01.2014г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.01.2014 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
<i>Акции - Холдинги</i>	1 156	0.16%
<i>Акции - Туризм</i>	7 866	1.07%
<i>Акции - Фармацевтична промишленост</i>	19 623	2.65%
<i>Акции - Недвижими имоти</i>	24 990	3.39%
<i>Акции - Тежка промишленост</i>	34 697	4.70%
<i>Чуждестранни инвестиции</i>	81 895	11.09%
<i>Корпоративни облигации</i>	244 809	33.16%
<i>Общински облигации</i>	14 063	1.91%
<i>Банкови депозити</i>	149 183	20.21%
<i>В брой и разплащателни сметки</i>	33 954	4.60%
<i>Вземания*</i>	125 911	17.06%
<i>Общо активи</i>	738 147	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 31/01/2014



- 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	292.04	1.000	\$292.04
Валутно деноминиран актив	USD	66.00	116.340	\$7 678.44
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	86.270	\$5 262.47
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	178.180	\$8 196.28

Обща рискова позиция	\$21 429.23
-----------------------------	-------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 15 600.00	1.356160	\$21 156.10	ОТС	България
Обща хеджираща позиция				\$21 156.10		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД