

**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 и корпоративни облигации. Падежирала е и корпоративна облигация.

Към 30.04.2014г. 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 30.04.2014г. възлиза на 12.19%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 11.37% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 30.04.2014г. корпоративните облигации представляват 28.20% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 1.94% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 18.46% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.04.2014г. са 5.51% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, начислени дивиденди, хеджиране и платени такси към КФН възлизат на 22.33% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.04.2014г. е 4.86% на годишна база\*, доходността от началото на годината е 1.84%, а доходността за последните 12 месеца към 30.04.2014г. е 4.24%.

**I. Данни по чл. 72, ал. 2 от Наредба № 44**

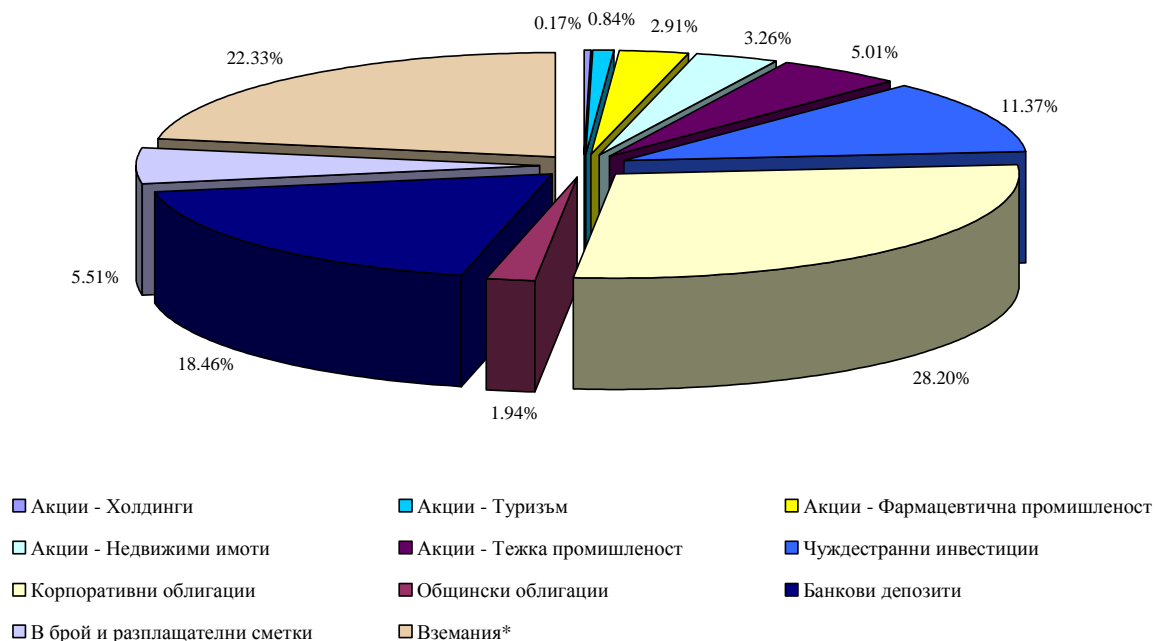
**1) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти**

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 30.04.2014г. 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 30.04.2014 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	1 254	0.17%
Акции - Туризъм	6 235	0.84%
Акции - Фармацевтична промишленост	21 591	2.91%
Акции - Недвижими имоти	24 141	3.26%
Акции - Тежка промишленост	37 175	5.01%
Чуждестранни инвестиции	84 273	11.37%
Корпоративни облигации	209 095	28.20%
Общински облигации	14 350	1.94%
Банкови депозити	136 908	18.46%
В брой и разплащателни сметки	40 862	5.51%
Вземания*	165 605	22.33%
Общо активи	741 489	100.00%

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

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 30/04/2014**


**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	378.73	1.000	\$378.73
Валутно деноминиран актив	USD	66.00	118.150	\$7 797.90
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	87.390	\$5 330.79
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	188.310	\$8 662.26

<b>Обща рискова позиция</b>	\$22 169.68
-----------------------------	-------------

<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	1.380140	\$21 530.18	OTC	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>				\$21 530.18		

Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД