

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 няма закупени или продадени облигации и акции.

Към 31.12.2013г. 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 31.12.2013г. възлиза на 11.37%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 11.25% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 31.12.2013г. корпоративните облигации представляват 33.49% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 1.91% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 20.29% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.12.2013г. са 4.40% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации и начислени дивиденди възлизат на 17.29% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.12.2013г. е 4.83% на годишна база*, доходността от началото на годината и доходността за последните 12 месеца към 30.12.2013г. е 5.27%.

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

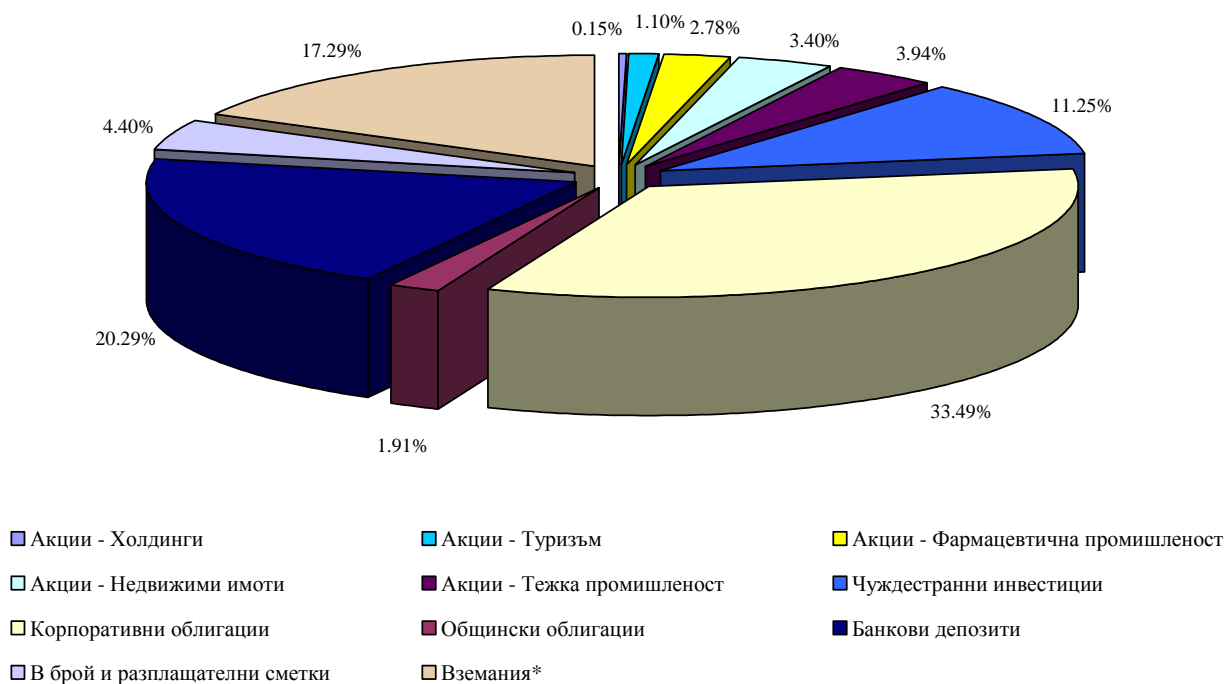
* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.12.2013г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.12.2013 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	1 102	0.15%
Акции - Туризм	8 064	1.10%
Акции - Фармацевтична промишленост	20 281	2.78%
Акции - Недвижими имоти	24 843	3.40%
Акции - Тежка промишленост	28 844	3.94%
Чуждестранни инвестиции	82 283	11.25%
Корпоративни облигации	244 911	33.49%
Общински облигации	13 947	1.91%
Банкови депозити	148 357	20.29%
В брой и разплащателни сметки	32 179	4.40%
Вземания*	126 454	17.29%
Общо активи	731 265	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 31/12/2013



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	236.89	1.000	\$236.89
Валутно деноминиран актив	USD	66.00	114.480	\$7 555.68
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	87.390	\$5 330.79
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	183.820	\$8 455.72

Обща рискова позиция	\$21 579.08
-----------------------------	-------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форурд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 15 600.00	1.378824	\$21 509.65	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$21 509.65		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД