

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 са закупени и продадени корпоративни облигации.

Към 31.07.2013г. 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 31.07.2013г. възлиза на 12.13%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 2.95% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 31.07.2013г. корпоративните облигации представляват 34.48% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 2.07% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 19.75% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.07.2013г. са 9.81% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, хеджиране, начислени дивиденди и платени такси към БФБ и КФН възлизат на 18.81% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.07.2013г. е 5.05% на годишна база*, доходността от началото на годината е 4.93%, а доходността за последните 12 месеца към 31.07.2013г. е 5.70%.

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

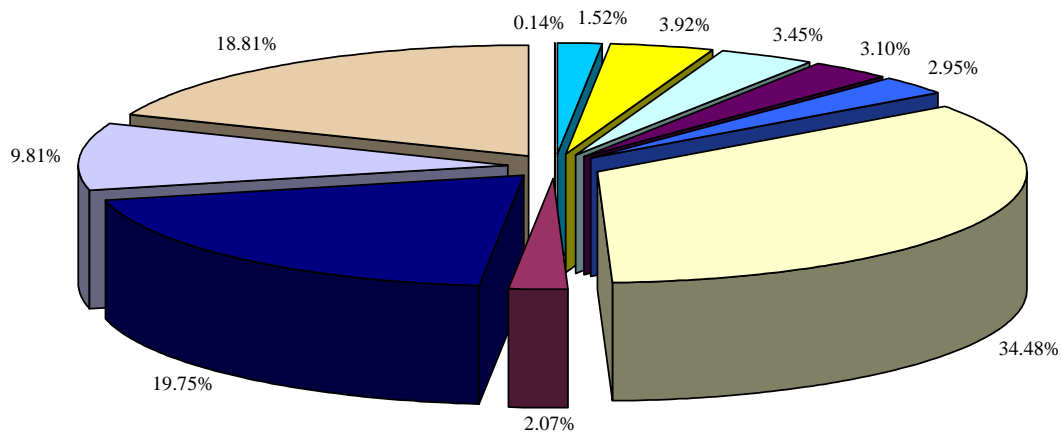
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.07.2013г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 31.07.2013 г.

Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	1 005	0.14%
Акции - Туризм	11 128	1.52%
Акции - Фармацевтична промишленост	28 620	3.92%
Акции - Недвижими имоти	25 190	3.45%
Акции - Тежка промишленост	22 604	3.10%
Чуждестранни инвестиции	21 548	2.95%
Корпоративни облигации	251 802	34.48%
Общински облигации	15 081	2.07%
Банкови депозити	144 222	19.75%
В брой и разплащателни сметки	71 664	9.81%
Вземания*	137 382	18.81%
Общо активи	730 246	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 31/07/2013


- 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.

Рисков актив				
ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
Валутно деноминиран актив	USD	1 726.93	1.000	\$1 726.93
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	168.710	\$7 760.66
Валутно деноминиран актив	USD	99.00	69.340	\$6 864.66
Обща рискова позиция				\$16 352.25

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 11 000.00	1.30517	\$14 356.87	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$14 356.87		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД