

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 и закупени корпоративни облигации.

Към 31.07.2014г. 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 31.07.2014г. възлиза на 10.48%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 11.53% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 31.07.2014г. корпоративните облигации представляват 25.14% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 1.77% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 18.66% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.07.2014г. са 9.94% 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 22.48% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.07.2014г. е 4.71% на годишна база*, доходността от началото на годината е 1.80%, а доходността за последните 12 месеца към 31.07.2014г. е 2.14%.

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

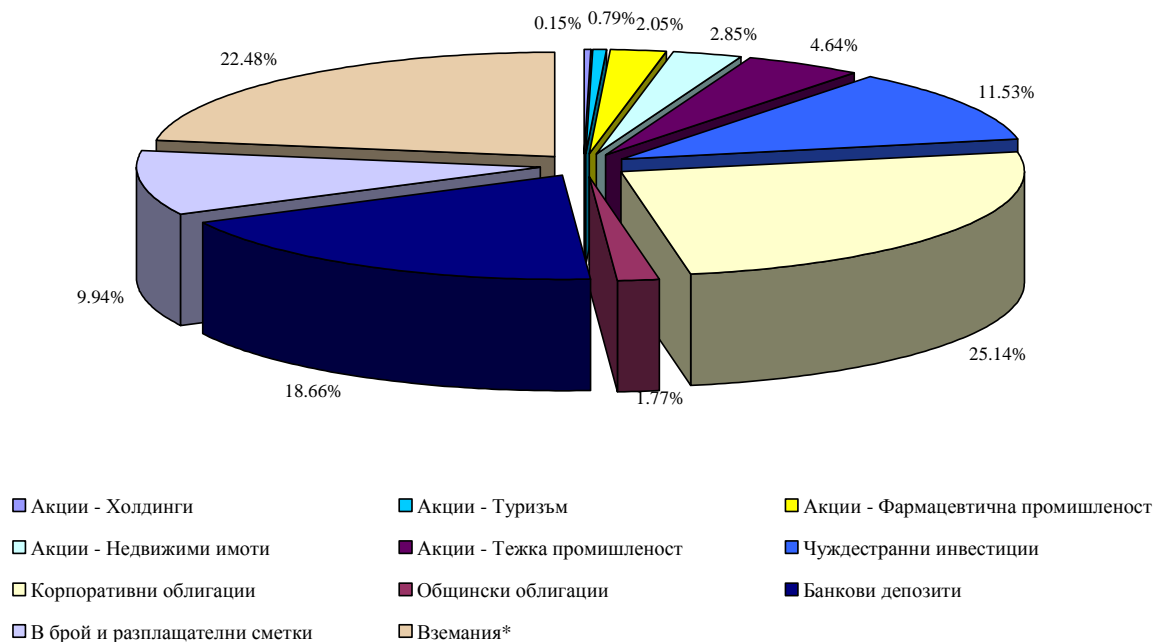
* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.07.2014г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.07.2014 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
<i>Акции - Холдинги</i>	1 143	0.15%
<i>Акции - Туризм</i>	5 838	0.79%
<i>Акции - Фармацевтична промишленост</i>	15 241	2.05%
<i>Акции - Недвижими имоти</i>	21 119	2.85%
<i>Акции - Тежка промишленост</i>	34 397	4.64%
<i>Чуждестранни инвестиции</i>	85 566	11.53%
<i>Корпоративни облигации</i>	186 529	25.14%
<i>Общински облигации</i>	13 100	1.77%
<i>Банкови депозити</i>	138 404	18.66%
<i>В брой и разплащателни сметки</i>	73 772	9.94%
<i>Вземания*</i>	166 774	22.48%
Общо активи	741 883	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 31/07/2014



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.

Рисков актив				
ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
Валутно деноминиран актив	USD	453.89	1.000	\$453.89
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	193.090	\$8 882.14
Валутно деноминиран актив	USD	66.00	118.550	\$7 824.30
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	95.020	\$5 796.22
Обща рискова позиция				\$22 956.55

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 16 500.00	1.354380	\$22 347.27	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$22 347.27		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД