

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 има продадени акции.

Към 30.04.2015г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт са разпределени в 4 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 30.04.2015г. възлиза на 9.48%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 21.93% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 30.04.2015г. корпоративните облигации представляват 25.62% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 1.82% от стойността на активите.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.04.2015г. са 13.72% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, вземане по договор, начислени дивиденди, хеджиране и платена такса КФН възлизат на 27.43% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.04.2015г. е 3.33% на годишна база*. Доходността от началото на годината е минус 3.63%, а доходността за последните 12 месеца към 30.04.2015г. е минус 8.64%.

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

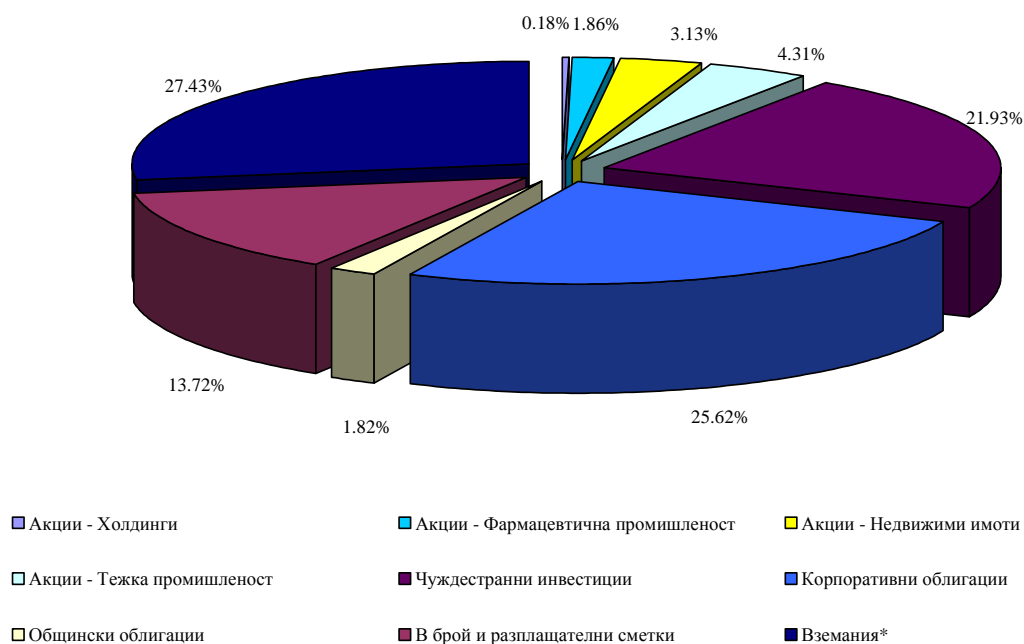
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 30.04.2015г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 30.04.2015 г.

Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	1 220	0.18%
Акции - Фармацевтична промишленост	12 365	1.86%
Акции - Недвижими имоти	20 814	3.13%
Акции - Тежка промишленост	28 664	4.31%
Чуждестранни инвестиции	145 880	21.93%
Корпоративни облигации	170 400	25.62%
Общински облигации	12 138	1.82%
В брой и разплащателни сметки	91 246	13.72%
Вземания*	182 430	27.43%
Общо активи	665 157	100.00%

* Вземания във връзка с начислени дивиденди, главница и лихва по облигационни емисии, платени такси към КФН, вземания от хеджиране и вземания по договор.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 30/04/2015


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	766.86	1.000	\$766.86
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	208.460	\$9 589.16
Валутно деноминиран актив	USD	188.00	119.940	\$22 548.72
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	107.630	\$6 565.43

Обща рискова позиция	\$39 470.17
-----------------------------	-------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 36 000.00	1.064480	\$38 321.28	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$38 321.28		

Красимир Петков
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД