

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 корпоративни облигации.

Към 30.06.2014г. 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 30.06.2014г. възлиза на 10.40%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 11.71% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 30.06.2014г. корпоративните облигации представляват 28.13% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 1.76% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 18.64% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.06.2014г. са 6.95% 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 22.41% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.06.2014г. е 4.75% на годишна база*, доходността от началото на годината е 1.70%, а доходността за последните 12 месеца към 30.06.2014г. е 2.65%.

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

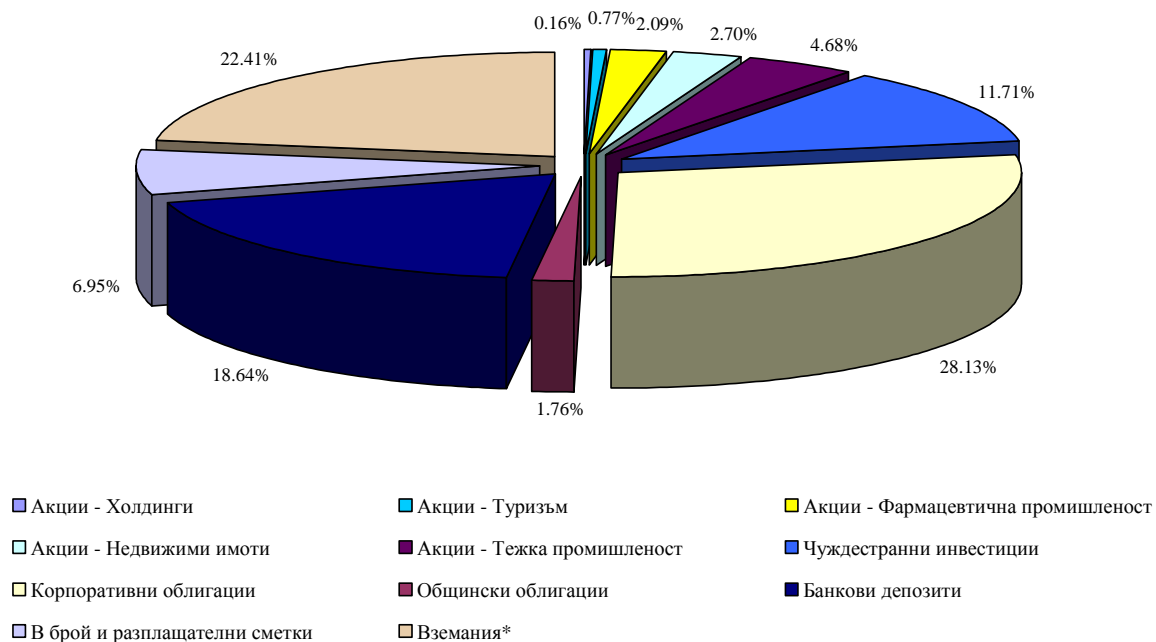
* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 30.06.2014г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 30.06.2014 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	1 192	0.16%
Акции - Туризм	5 675	0.77%
Акции - Фармацевтична промишленост	15 487	2.09%
Акции - Недвижими имоти	20 034	2.70%
Акции - Тежка промишленост	34 688	4.68%
Чуждестранни инвестиции	86 709	11.71%
Корпоративни облигации	208 379	28.13%
Общински облигации	13 022	1.76%
Банкови депозити	138 049	18.64%
В брой и разплащателни сметки	51 484	6.95%
Вземания*	165 956	22.41%
Общо активи	740 675	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 30/06/2014



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	401.95	1.000	\$401.95
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	195.720	\$9 003.12
Валутно деноминиран актив	USD	66.00	119.260	\$7 871.16
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	93.910	\$5 728.51
Обща рискова позиция				\$23 004.74

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 16 500.00	1.356384	\$22 380.34	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$22 380.34		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД