



**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 и закупени чуждестранни инвестиции.

Към 31.05.2015г. 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 31.05.2015г. възлиза на 9.19%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 25.87% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 31.05.2015г. корпоративните облигации представляват 23.64% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 1.84% от стойността на активите.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.05.2015г. са 12.58% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, вземане по договор и платена такса КФН възлизат на 26.88% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.05.2015г. е 3.27% на годишна база*. Доходността от началото на годината е минус 3.86%, а доходността за последните 12 месеца към 29.05.2015г. е минус 9.04%.

I. Данни по чл. 72, ал. 2 от Наредба № 44

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 31.05.2015г. е представена в следната таблица и графика.

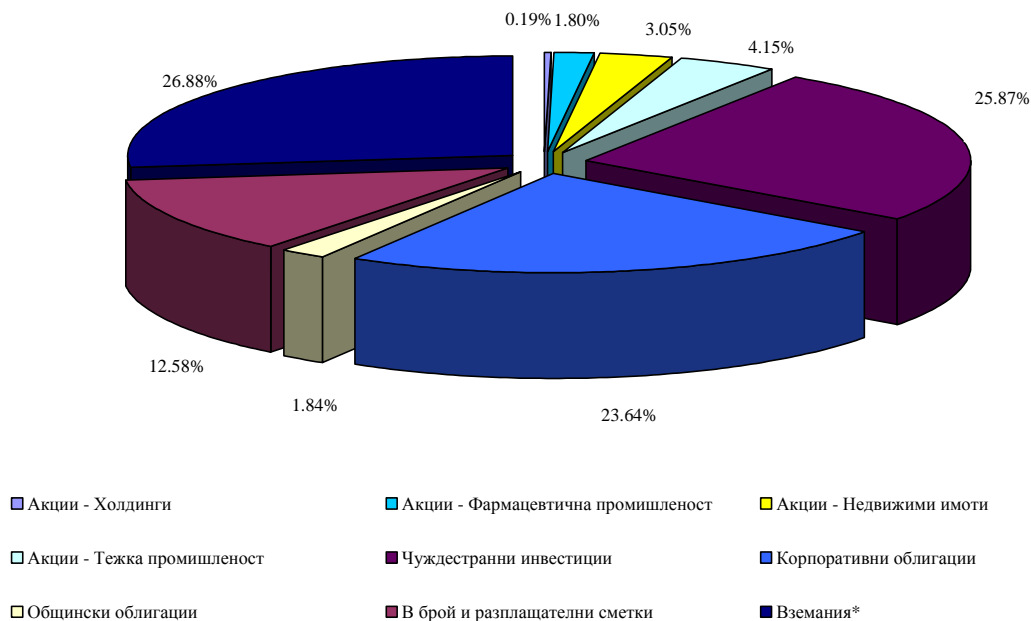
* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.



Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.05.2015 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	1 264	0.19%
Акции - Фармацевтична промишленост	11 960	1.80%
Акции - Недвижими имоти	20 289	3.05%
Акции - Тежка промишленост	27 570	4.15%
Чуждестранни инвестиции	171 992	25.87%
Корпоративни облигации	157 149	23.64%
Общински облигации	12 249	1.84%
В брой и разплащателни сметки	83 656	12.58%
Вземания*	178 694	26.88%
Общо активи	664 823	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 31/05/2015





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	806.95	1.000	\$806.95
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	211.140	\$9 712.44
Валутно деноминиран актив	USD	188.00	118.270	\$22 234.76
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	110.050	\$6 713.05

Обща рискова позиция	\$39 467.20
-----------------------------	-------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 36 000.00	1.125670	\$40 524.12	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$40 524.12		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД