

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 няма закупени или продадени облигации и акции.

Към 31.12.2014г. 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 31.12.2014г. възлиза на 10.05%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 18.97% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 31.12.2014г. корпоративните облигации представляват 24.84% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 1.70% от стойността на активите.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.12.2014г. са 6.80% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, вземане по договор и дивиденди възлизат на 37.64% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.12.2014г. е 3.88% на годишна база*, доходността от началото на годината и доходността за последните 12 месеца към 30.12.2014г. е минус 3.45%.

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

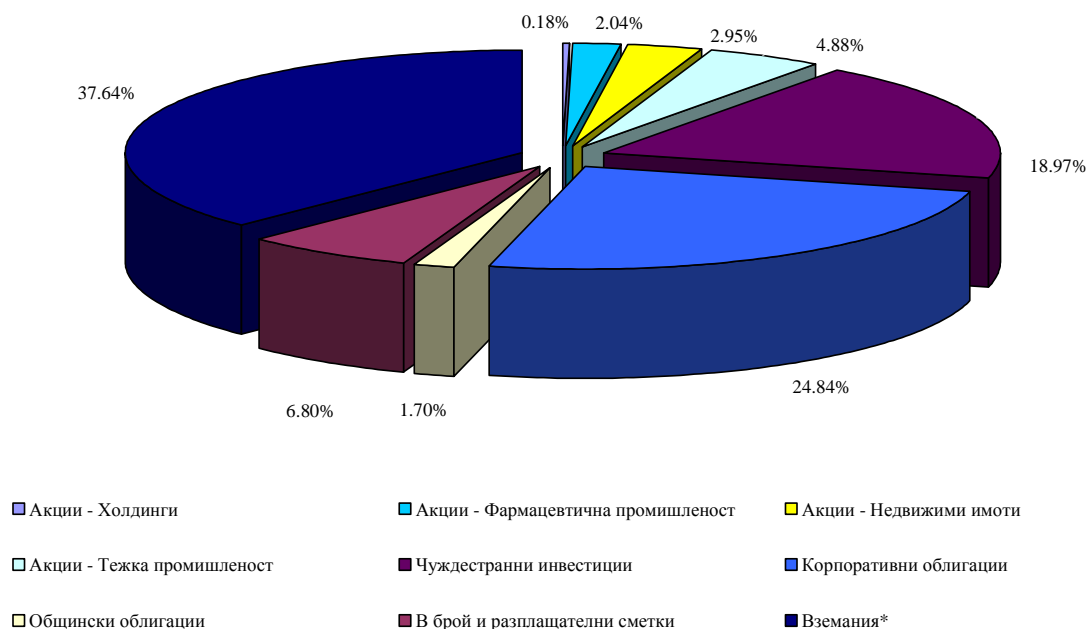
1) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.12.2014г. 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 31.12.2014 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	1 300	0.18%
Акции - Фармацевтична промишленост	14 341	2.04%
Акции - Недвижими имоти	20 745	2.95%
Акции - Тежка промишленост	34 328	4.88%
Чуждестранни инвестиции	133 426	18.97%
Корпоративни облигации	174 669	24.84%
Общински облигации	11 940	1.70%
В брой и разплащателни сметки	47 854	6.80%
Вземания*	264 690	37.64%
Общо активи	703 293	100.00%

* Вземания във връзка с главница и лихва по облигационни емисии, вземане по договор и дивиденди.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 31/12/2014


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	513.87	1.000	\$513.87
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	207.600	\$9 549.60
Валутно деноминиран актив	USD	188.00	119.330	\$22 434.04
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	104.320	\$6 363.52
Обща рискова позиция				\$38 861.03

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 28 500.00	1.243400	\$35 436.90	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$35 436.90		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД