

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 акции и корпоративни облигации. Продадени са и закупени и чуждестранни инвестиции.

Към 30.11.2013г. 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 30.11.2013г. възлиза на 10.87%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 11.19% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 30.11.2013г. корпоративните облигации представляват 33.46% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 2.10% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 20.07% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.11.2013г. са 3.38% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, хеджиране, начислени дивиденди и платени такси към БФБ и КФН възлизат на 18.93% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.11.2013г. е 4.95% на годишна база*, доходността от началото на годината е 5.84%, а доходността за последните 12 месеца към 29.11.2013г. е 6.59%.

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

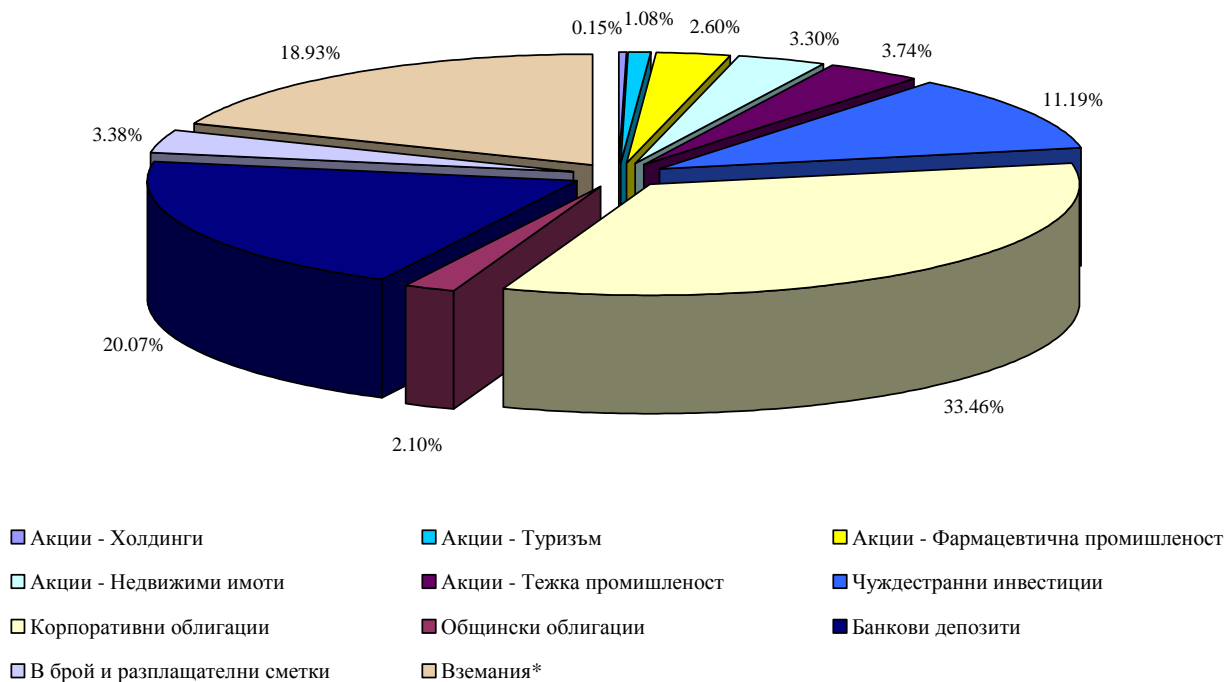
* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 30.11.2013г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 30.11.2013 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	1 073	0.15%
Акции - Туризм	7 931	1.08%
Акции - Фармацевтична промишленост	19 157	2.60%
Акции - Недвижими имоти	24 315	3.30%
Акции - Тежка промишленост	27 494	3.74%
Чуждестранни инвестиции	82 180	11.19%
Корпоративни облигации	245 963	33.46%
Общински облигации	15 464	2.10%
Банкови депозити	147 502	20.07%
В брой и разплащателни сметки	24 844	3.38%
Вземания*	139 104	18.93%
Общо активи	735 027	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 30/11/2013



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
Парични средства във валута	USD	221.21	1.000	\$221.21
US4642872422	USD	66.00	114.660	\$7 567.56
US73935A1043	USD	61.00	85.730	\$5 229.53
US78462F1030	USD	46.00	181.000	\$8 326.00

Обща рискова позиция	\$21 344.30
-----------------------------	-------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форурд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 15 600.00	1.344380	\$20 972.33	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$20 972.33		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД