

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 закупени корпоративни облигации и са продадени ипотечни облигации. Продадени са и чуждестранни инвестиции.

Към 31.03.2013г. 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 31.03.2013г. възлиза на 10.62%.

Към 31.03.2013г. корпоративните облигации представляват 34.70% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, ипотечните облигации – 6.38%, а общинските 2.26% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 19.54% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.03.2013г. са 7.61% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации и платени такси към БФБ и КФН възлизат на 18.89% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.03.2013г. е 4.94% на годишна база*, доходността от началото на годината е 2.39%, а доходността за последните 12 месеца към 29.03.2013г. е 5.39%.

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

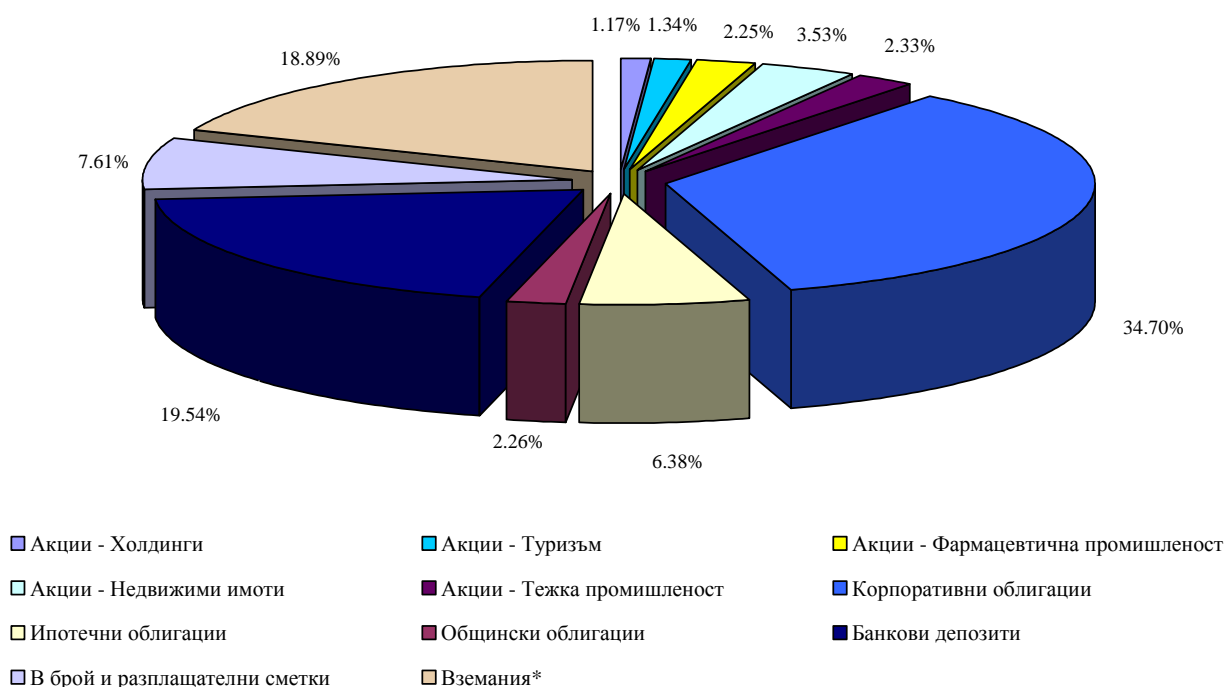
* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.03.2013г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ "Ти Би Ай Комфорт" към 31/03/2013		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	8 447	1.17%
Акции - Туризм	9 630	1.34%
Акции - Фармацевтична промишленост	16 267	2.25%
Акции - Недвижими имоти	25 456	3.53%
Акции - Тежка промишленост	16 796	2.33%
Корпоративни облигации	250 165	34.70%
Ипотечни облигации	46 029	6.38%
Общински облигации	16 333	2.26%
Банкови депозити	140 902	19.54%
В брой и разплащателни сметки	54 912	7.61%
Вземания*	136 217	18.89%
Общо активи	721 154	100.00%

* Вземания във връзка лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации и платени такси към БФБ и КФН.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 31/03/2013



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
Валутно деноминиран актив	USD	16 052.35	1.0000	\$16 052.35

Обща рискова позиция	\$16 052.35
-----------------------------	-------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 11 000.00	1.29557	\$14 251.27	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$14 251.27		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД