

**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 и са продадени акции и корпоративни облигации. Закупени са и чуждестранни инвестиции.

Към 30.04.2013г. 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 30.04.2013г. възлиза на 10.79%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 3.07% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 30.04.2013г. корпоративните облигации представляват 34.56% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, ипотечните облигации – 6.42%, а общинските 2.28% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 19.65% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.04.2013г. са 4.47% 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 18.76% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.04.2013г. е 4.95% на годишна база\*, доходността от началото на годината е 2.85%, а доходността за последните 12 месеца към 30.04.2013г. е 5.40%.

**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**

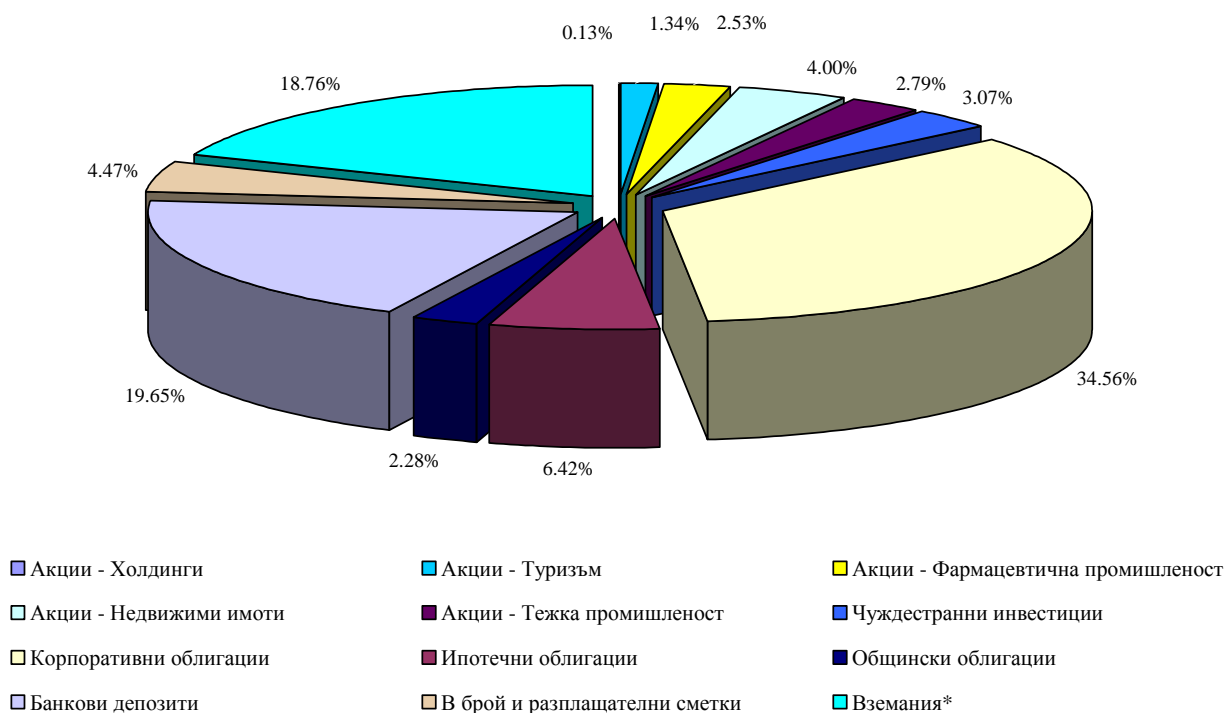
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 30.04.2013г. е представена в следната таблица и графика.

\* 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 30/04/2013**

Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	951	0.13%
Акции - Туризм	9 630	1.34%
Акции - Фармацевтична промишленост	18 215	2.53%
Акции - Недвижими имоти	28 899	4.00%
Акции - Тежка промишленост	20 137	2.79%
Чуждестранни инвестиции	22 141	3.07%
Корпоративни облигации	249 257	34.56%
Ипотечни облигации	46 345	6.42%
Общински облигации	16 442	2.28%
Банкови депозити	141 742	19.65%
В брой и разплащателни сметки	32 232	4.47%
Вземания*	135 275	18.76%
Общо активи	721 266	100.00%

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

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 30/04/2013**


**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.

<b>Рисков актив</b>				
<b>ISIN</b>	<b>Валута</b>	<b>Брой</b>	<b>Цена</b>	<b>Обща Стойност</b>
Валутно деноминиран актив	USD	1 667.91	1.0000	\$1 667.91
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	159.6800	\$7 345.28
Валутно деноминиран актив	USD	99.00	75.2800	\$7 452.72
<b>Обща рискова позиция</b>				<b>\$16 465.91</b>

<b>Деривативен инструмент</b>						
<b>Вид</b>	<b>Валута</b>	<b>Брой</b>	<b>Цена</b>	<b>Обща Стойност</b>	<b>Пазар</b>	<b>Държава</b>
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 11 000.00	1.308640	\$14 395.04	OTC	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>				<b>\$14 395.04</b>		

Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД