

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 са закупени корпоративни облигации.

Към 31.03.2014г. 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 31.03.2014г. възлиза на 12.13%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 11.15% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 31.03.2014г. корпоративните облигации представляват 36.10% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 1.90% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 20.11% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.03.2014г. са 1.71% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, начислени дивиденди и платени такси към КФН възлизат на 16.90% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.03.2014г. е 5.03% на годишна база*, доходността от началото на годината е 2.79%, а доходността за последните 12 месеца към 31.03.2014г. е 5.68%.

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

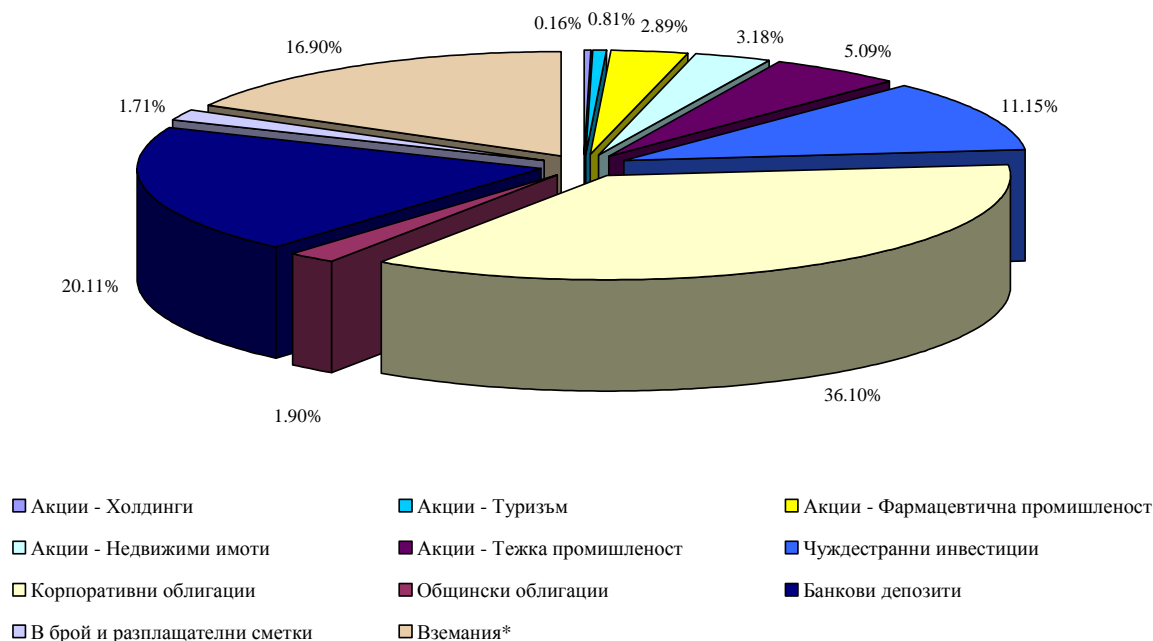
1) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.03.2014г. 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 31.03.2014 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	1 208	0.16%
Акции - Туризм	6 076	0.81%
Акции - Фармацевтична промишленост	21 670	2.89%
Акции - Недвижими имоти	23 842	3.18%
Акции - Тежка промишленост	38 197	5.09%
Чуждестранни инвестиции	83 599	11.15%
Корпоративни облигации	270 744	36.10%
Общински облигации	14 274	1.90%
Банкови депозити	150 837	20.11%
В брой и разплащателни сметки	12 771	1.71%
Вземания*	126 740	16.90%
Общо активи	749 958	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 31/03/2014


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	331.83	1.000	\$331.83
Валутно деноминиран актив	USD	66.00	116.940	\$7 718.04
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	87.670	\$5 347.87
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	187.010	\$8 602.46
Обща рискова позиция				\$22 000.20

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 15 600.00	1.391330	\$21 704.75	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$21 704.75		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД