

**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 от български публични дружества, търгувани на БФБ – София АД. През периода са закупени и продадени корпоративни облигации, закупени са и ипотечни облигации.

Към 31.01.2013г. 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 31.01.2013г. възлиза на 10.29%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 3.12% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 31.01.2013г. корпоративните облигации представляват 36.04% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, ипотечните облигации – 6.10%, а общинските 2.27% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 15.16% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.01.2013г. са 3.57% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, хеджиране, вземания по депозит и платени такси към БФБ и КФН възлизат на 23.45% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.01.2013г. е 4.91% на годишна база\*, доходността от началото на годината е 1.41%, а доходността за последните 12 месеца към 31.01.2013г. е 4.95%.

**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**

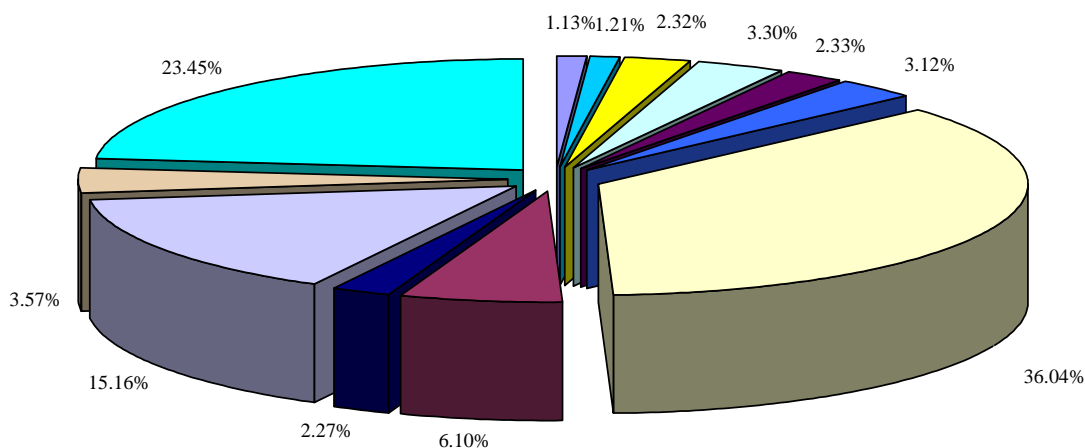
\* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.01.2013г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ "Ти Би Ай Комфорт" към 31/01/2013		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	8 023	1.13%
Акции - Туризм	8 652	1.21%
Акции - Фармацевтична промишленост	16 527	2.32%
Акции - Недвижими имоти	23 519	3.30%
Акции - Тежка промишленост	16 632	2.33%
Чуждестранни инвестиции	22 256	3.12%
Корпоративни облигации	256 836	36.04%
Ипотечни облигации	43 491	6.10%
Общински облигации	16 143	2.27%
Банкови депозити	108 016	15.16%
В брой и разплащателни сметки	25 401	3.57%
Вземания*	167 128	23.45%
Общо активи	712 624	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 31/01/2013



- Акции - Холдинги
- Акции - Туризм
- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Недвижими имоти
- Акции - Тежка промишленост
- Чуждестранни инвестиции
- Корпоративни облигации
- Ипотечни облигации
- Общински облигации
- Банкови депозити
- В брой и разплащателни сметки
- Вземания\*

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	208.12	1.0000	\$208.12
Валутно деноминиран актив	USD	103.00	149.7000	\$15 419.10

<b>Обща рискова позиция</b>	<b>\$15 627.22</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	1.328730	\$14 616.03	OTC	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>				<b>\$14 616.03</b>		

Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД