

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 продадени акции.

Към 30.11.2014г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт са разпределени в 4 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 30.11.2014г. възлиза на 9.64%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 18.61% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 30.11.2014г. корпоративните облигации представляват 24.63% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 1.88% от стойността на активите.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.11.2014г. са 6.31% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, вземане по договор, дивиденди, хеджиране и платена такса към КФН възлизат на 38.93% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 28.11.2014г. е 4.13% на годишна база*, доходността от началото на годината е минус 1.67%, а доходността за последните 12 месеца към 28.11.2014г. е минус 2.16%.

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

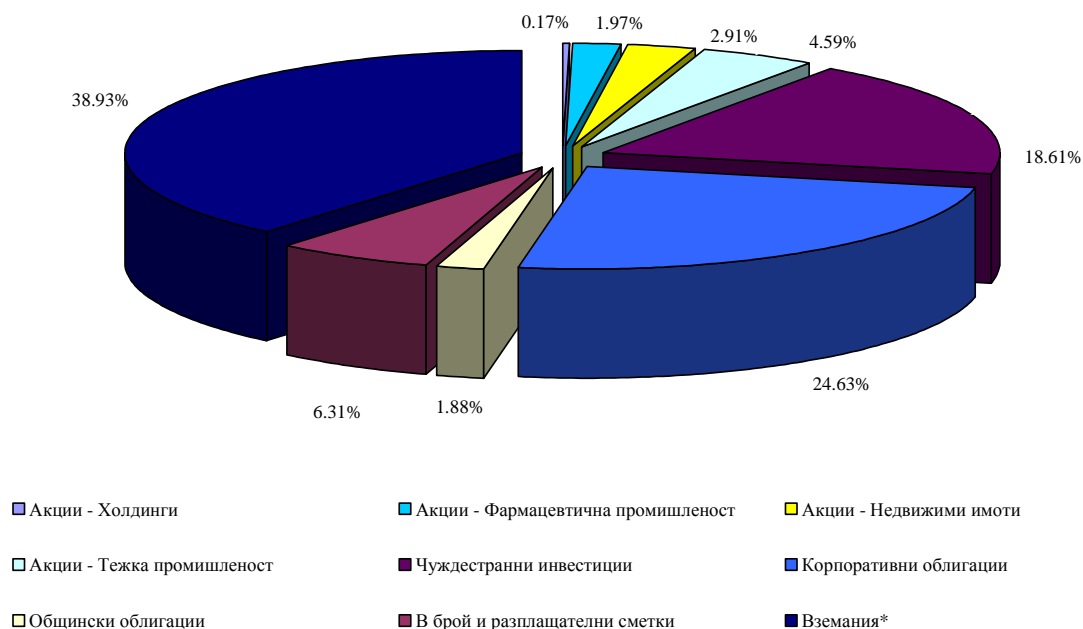
1) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 30.11.2014г. 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 30.11.2014 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
<i>Акции - Холдинги</i>	1 213	0.17%
<i>Акции - Фармацевтична промишленост</i>	14 102	1.97%
<i>Акции - Недвижими имоти</i>	20 796	2.91%
<i>Акции - Тежка промишленост</i>	32 825	4.59%
<i>Чуждестранни инвестиции</i>	133 003	18.61%
<i>Корпоративни облигации</i>	176 001	24.63%
<i>Общински облигации</i>	13 400	1.88%
<i>В брой и разплащателни сметки</i>	45 088	6.31%
<i>Вземания*</i>	278 156	38.93%
<i>Общо активи</i>	714 584	100.00%

* Вземания във връзка с главница и лихва по облигационни емисии, вземане по договор, дивиденди, хеджиране и платена такса към КФН.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 30/11/2014


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	473.42	1.000	\$473.42
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	207.200	\$9 531.20
Валутно деноминиран актив	USD	188.00	120.090	\$22 576.92
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	106.010	\$6 466.61
Обща рискова позиция				\$39 048.15

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 28 500.00	1.246000	\$35 511.00	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$35 511.00		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД