

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 корпоративни облигации.

Към 31.10.2013г. 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 31.10.2013г. възлиза на 13.30%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 2.92% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 31.10.2013г. корпоративните облигации представляват 34.10% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 2.10% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 20.01% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.10.2013г. са 9.08% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, начислени дивиденди и платени такси към БФБ и КФН възлизат на 18.49% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.10.2013г. е 4.96% на годишна база*, доходността от началото на годината е 5.52%, а доходността за последните 12 месеца към 31.10.2013г. е 6.09%.

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

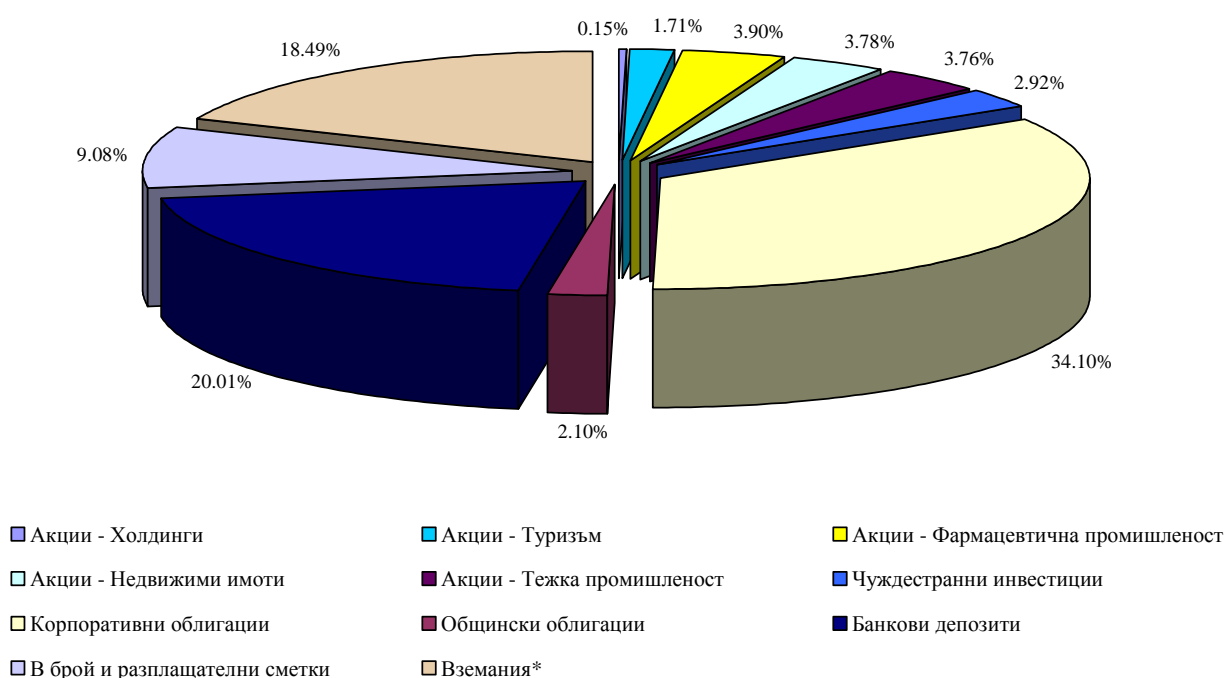
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.10.2013г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 31.10.2013 г.

Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	1 110	0.15%
Акции - Туризм	12 519	1.71%
Акции - Фармацевтична промишленост	28 585	3.90%
Акции - Недвижими имоти	27 698	3.78%
Акции - Тежка промишленост	27 542	3.76%
Чуждестранни инвестиции	21 407	2.92%
Корпоративни облигации	249 931	34.10%
Общински облигации	15 401	2.10%
Банкови депозити	146 703	20.01%
В брой и разплащателни сметки	66 591	9.08%
Вземания*	135 568	18.49%
Общо активи	733 055	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 31/10/2013


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
Парични средства във валута	USD	1 784.74	1.000	\$1 784.74
US78462F1030	USD	46.00	175.790	\$8 086.34
US9229085538	USD	99.00	69.130	\$6 843.87

Обща рискова позиция	\$16 714.95
-----------------------------	-------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 11 000.00	1.382250	\$15 204.75	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$15 204.75		

Красимир Петков
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД