

**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 корпоративни облигации.

Към 30.09.2013г. 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 30.09.2013г. възлиза на 14.40%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 2.82% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 30.09.2013г. корпоративните облигации представляват 34.50% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 2.08% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 19.89% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.09.2013г. са 7.77% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, хеджиране, начислени дивиденди и платени такси към БФБ и КФН възлизат на 18.54% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.09.2013г. е 5.03% на годишна база\*, доходността от началото на годината е 5.63%, а доходността за последните 12 месеца към 30.09.2013г. е 6.27%.

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

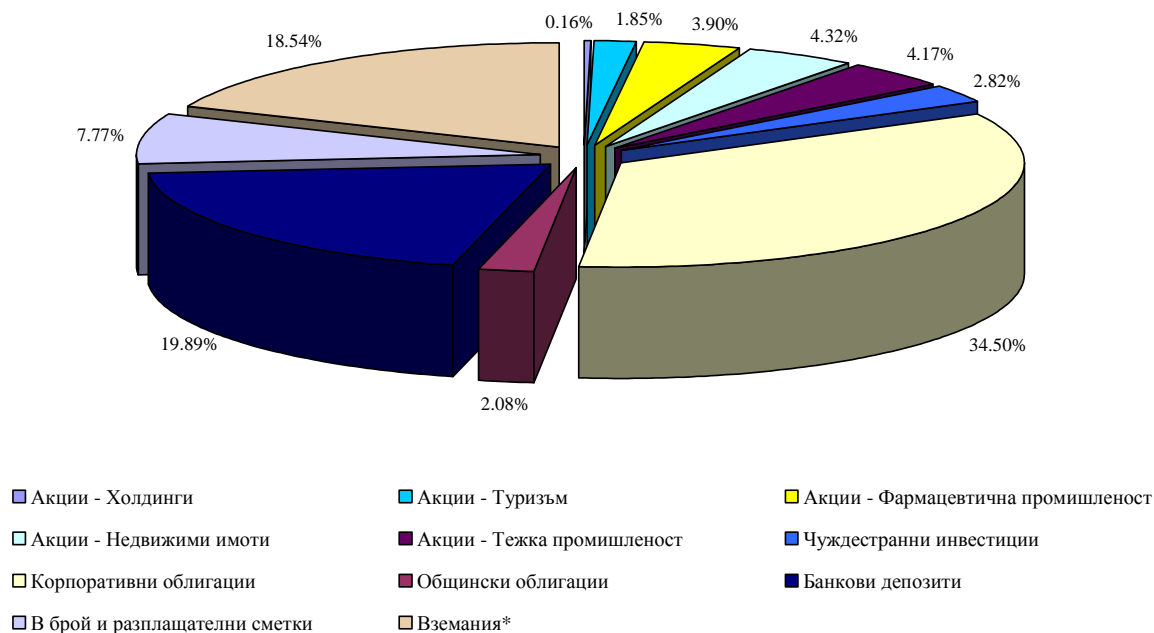
**1) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти**

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 30.09.2013г. е представена в следната таблица и графика.

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

<b>Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 30.09.2013 г.</b>		
<b>Актив</b>	<b>Стойност в лева</b>	<b>Процент от активите</b>
Акции - Холдинги	1 147	0.16%
Акции - Туризм	13 531	1.85%
Акции - Фармацевтична промишленост	28 627	3.90%
Акции - Недвижими имоти	31 709	4.32%
Акции - Тежка промишленост	30 586	4.17%
Чуждестранни инвестиции	20 675	2.82%
Корпоративни облигации	252 977	34.50%
Общински облигации	15 272	2.08%
Банкови депозити	145 876	19.89%
В брой и разплащателни сметки	57 001	7.77%
Вземания*	135 977	18.54%
<b>Общо активи</b>	<b>733 378</b>	<b>100.00%</b>

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

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 30/09/2013**


**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	1 761.83	1.000	\$1 761.83
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	168.010	\$7 728.46
Валутно деноминиран актив	USD	99.00	66.140	\$6 547.86

<b>Обща рискова позиция</b>	\$16 038.15
-----------------------------	-------------

<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	1.330280	\$14 633.08	OTC	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>				\$14 633.08		

Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД