

**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 няма закупени или продадени облигации и акции.

Към 31.01.2015г. 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 31.01.2015г. възлиза на 9.83%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 20.30% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 31.01.2015г. корпоративните облигации представляват 24.92% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 1.71% от стойността на активите.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.01.2015г. са 5.53% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии и вземане по договор възлизат на 37.71% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.01.2015г. е 3.87% на годишна база\*, доходността от началото на годината е 0.27%, а доходността за последните 12 месеца към 30.01.2015г. е минус 4.10%.

**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**

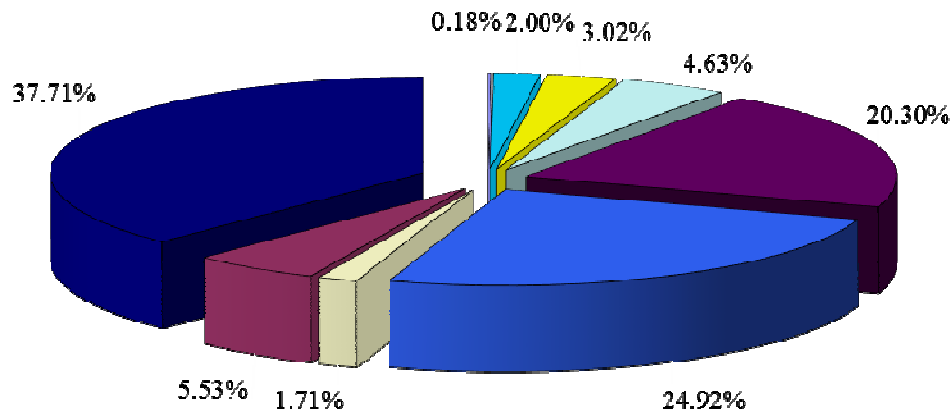
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.01.2015г. е представена в следната таблица и графика.

\* 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 31.01.2015 г.</b>		
<b>Актив</b>	<b>Стойност в лева</b>	<b>Процент от активите</b>
Акции - Холдинги	1 230	0.18%
Акции - Фармацевтична промишленост	13 993	2.00%
Акции - Недвижими имоти	21 133	3.02%
Акции - Тежка промишленост	32 400	4.63%
Чуждестранни инвестиции	141 975	20.30%
Корпоративни облигации	174 338	24.92%
Общински облигации	11 967	1.71%
В брой и разплащателни сметки	38 699	5.53%
Вземания*	263 767	37.71%
<b>Общо активи</b>	<b>699 502</b>	<b>100.00%</b>

\* Вземания за главница и лихва по облигационни емисии и вземане по договор.

### Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 31/01/2015



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

**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	605.77	1.000	\$605.77
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	199.450	\$9 174.70
Валутно деноминиран актив	USD	188.00	123.890	\$23 291.32
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	101.100	\$6 167.10
<b>Обща рискова позиция</b>				\$39 238.89

<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	€ 28 500.00	1.179000	\$33 601.50	OTC	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>				\$33 601.50		

Красимир Петков  
 Изпълнителен директор  
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов  
 Изпълнителен директор  
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД