

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 28.02.2015г. 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 28.02.2015г. възлиза на 9.68%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 20.93% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 28.02.2015г. корпоративните облигации представляват 24.49% 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 28.02.2015г. са 5.37% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, вземане по договор и платена такса КФН възлизат на 37.82% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 27.02.2015г. е 3.87% на годишна база*, доходността от началото на годината е 0.56%, а доходността за последните 12 месеца към 27.02.2015г. е минус 5.11%.

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

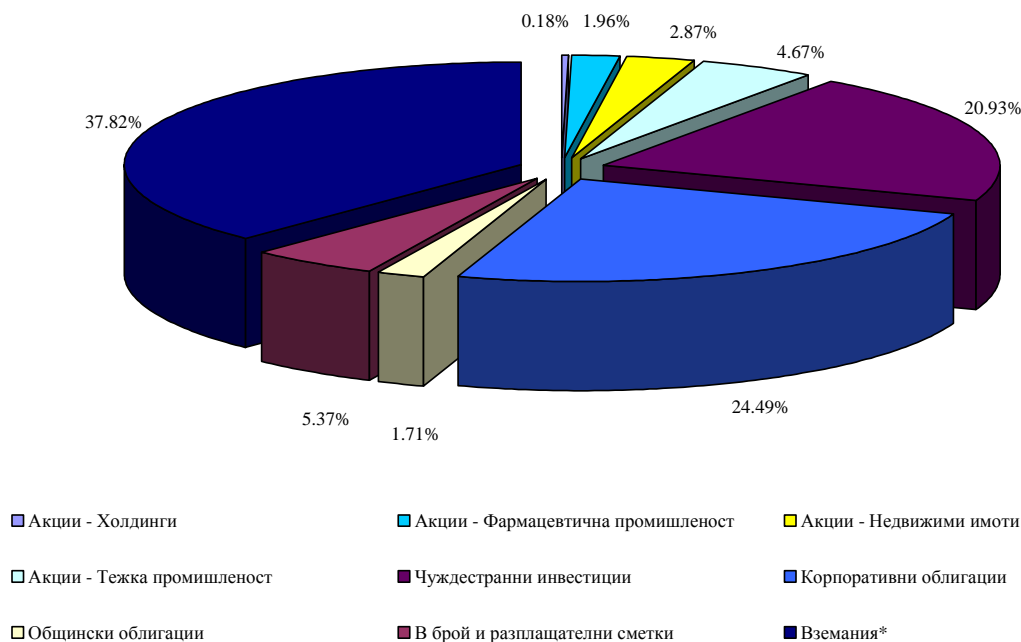
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 28.02.2015г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 28.02.2015 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	1 232	0.18%
Акции - Фармацевтична промишленост	13 688	1.96%
Акции - Недвижими имоти	20 068	2.87%
Акции - Тежка промишленост	32 619	4.67%
Чуждестранни инвестиции	146 243	20.93%
Корпоративни облигации	171 049	24.49%
Общински облигации	11 991	1.71%
В брой и разплащателни сметки	37 493	5.37%
Вземания*	264 165	37.82%
Общо активи	698 548	100.00%

* Вземания за главница и лихва по облигационни емисии, вземане по договор и платена такса КФН.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 28/02/2015



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.

ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
Валутно деноминиран актив	USD	646.49	1.000	\$646.49
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	210.660	\$9 690.36
Валутно деноминиран актив	USD	188.00	121.800	\$22 898.40
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	108.400	\$6 612.40

Обща рискова позиция	\$39 847.65
-----------------------------	-------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 28 500.00	1.133210	\$32 296.49	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$32 296.49		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД