

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 са закупени корпоративни облигации.

Към 31.05.2014г. 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 31.05.2014г. възлиза на 11.19%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 11.66% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 31.05.2014г. корпоративните облигации представляват 27.99% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 1.94% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 18.48% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.05.2014г. са 6.14% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, начислени дивиденди, и платени такси към КФН възлизат на 22.60% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.05.2014г. е 4.85% на годишна база*, доходността от началото на годината е 2.13%, а доходността за последните 12 месеца към 31.05.2014г. е 3.31%.

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

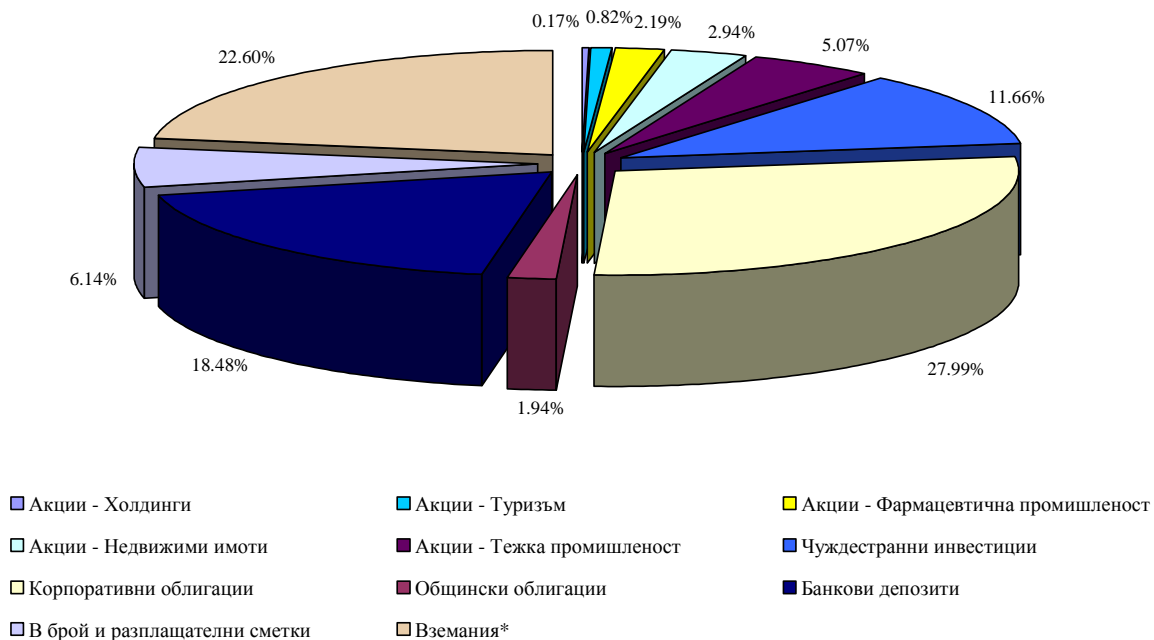
* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.05.2014г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.05.2014 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
<i>Акции - Холдинги</i>	1 267	0.17%
<i>Акции - Туризм</i>	6 107	0.82%
<i>Акции - Фармацевтична промишленост</i>	16 294	2.19%
<i>Акции - Недвижими имоти</i>	21 901	2.94%
<i>Акции - Тежка промишленост</i>	37 685	5.07%
<i>Чуждестранни инвестиции</i>	86 728	11.66%
<i>Корпоративни облигации</i>	208 185	27.99%
<i>Общински облигации</i>	14 439	1.94%
<i>Банкови депозити</i>	137 478	18.48%
<i>В брой и разплащателни сметки</i>	45 665	6.14%
<i>Вземания*</i>	168 132	22.60%
<i>Общо активи</i>	743 881	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 31/05/2014



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	390.43	1.000	\$390.43
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	192.680	\$8 863.28
Валутно деноминиран актив	USD	66.00	119.590	\$7 892.94
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	91.310	\$5 569.91
Обща рискова позиция				\$22 716.56

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 15 600.00	1.366140	\$21 311.78	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$21 311.78		

Красимир Петков
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД