

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 закупени и продадени корпоративни облигации, закупени са и ипотечни облигации.

Към 28.02.2013г. 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 28.02.2013г. възлиза на 10.10%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 3.26% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 28.02.2013г. корпоративните облигации представляват 34.72% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, ипотечните облигации – 6.69%, а общинските 2.27% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 19.63% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 28.02.2013г. са 4.24% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации и платени такси към БФБ и КФН възлизат на 19.09% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 28.02.2013г. е 4.87% на годишна база*, доходността от началото на годината е 1.48%, а доходността за последните 12 месеца към 28.02.2013г. е 5.08%.

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

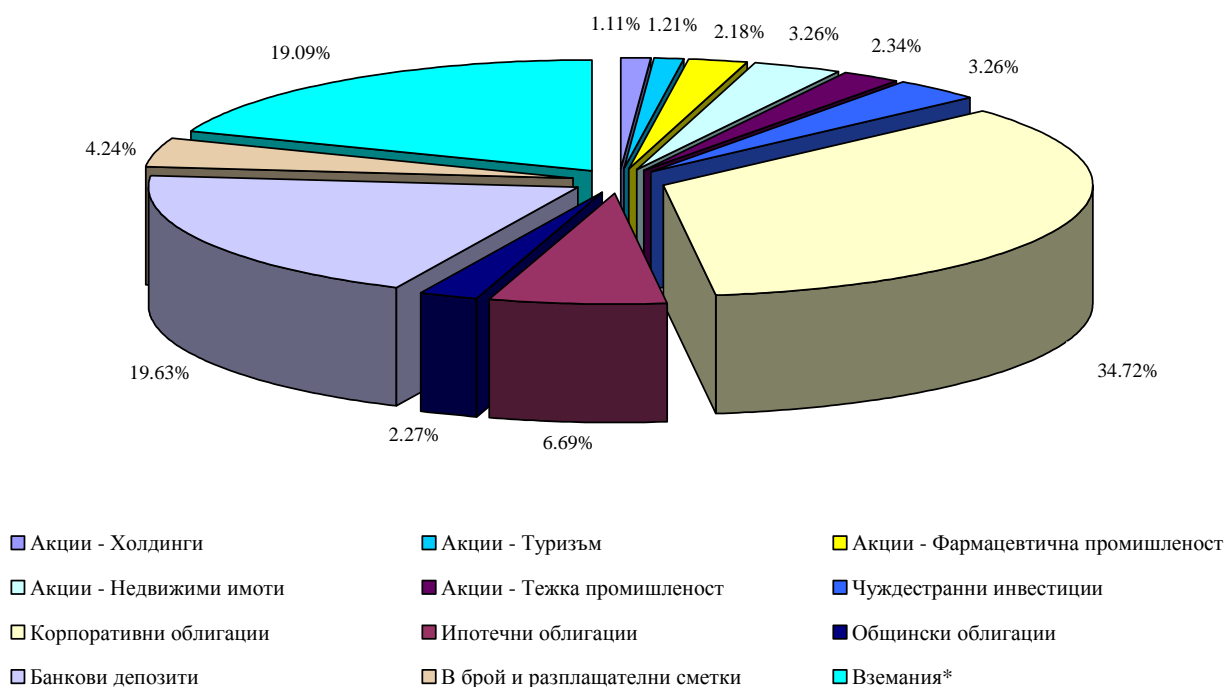
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 28.02.2013г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 28/02/2013

Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	7 889	1.11%
Акции - Туризм	8 603	1.21%
Акции - Фармацевтична промишленост	15 535	2.18%
Акции - Недвижими имоти	23 295	3.26%
Акции - Тежка промишленост	16 725	2.34%
Чуждестранни инвестиции	23 263	3.26%
Корпоративни облигации	247 740	34.72%
Ипотечни облигации	47 732	6.69%
Общински облигации	16 234	2.27%
Банкови депозити	140 062	19.63%
В брой и разплащателни сметки	30 249	4.24%
Вземания*	136 268	19.09%
Общо активи	713 595	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 28/02/2013


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
Валутно деноминиран актив	USD	204.03	1.0000	\$204.03
Валутно деноминиран актив	USD	103.00	151.6100	\$15 615.83
Обща рискова позиция				\$15 819.86

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 11 000.00	1.339450	\$14 733.95	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$14 733.95		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД