

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

Към 31.05.2013г. 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 31.05.2013г. възлиза на 11.93%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 2.99% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 31.05.2013г. корпоративните облигации представляват 33.58% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, ипотечните облигации – 6.95%, а общинските 2.27% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 19.53% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.05.2013г. са 3.50% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, от хеджиране, начислени дивиденди и платени такси към БФБ и КФН възлизат на 19.25% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.05.2013г. е 5.06% на годишна база*, доходността от началото на годината е 4.07%, а доходността за последните 12 месеца към 31.05.2013г. е 7.12%.

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

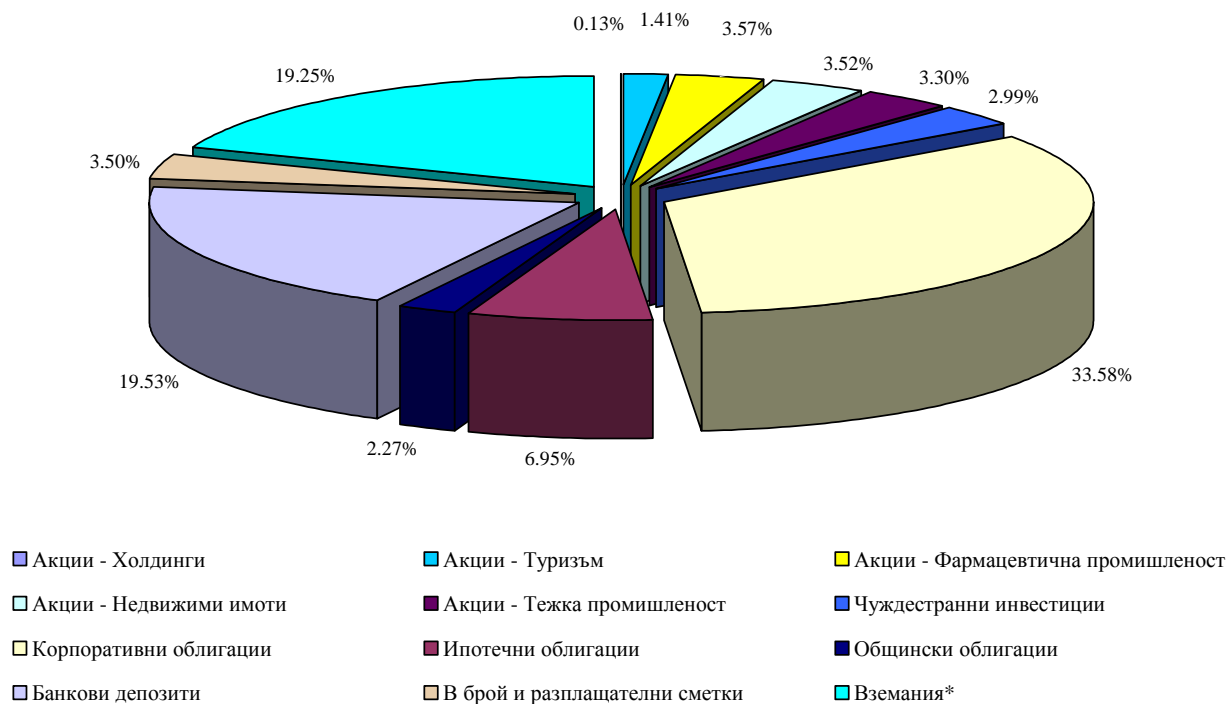
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.05.2013г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 31.05.2013 г.

Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	974	0.13%
Акции - Туризм	10 274	1.41%
Акции - Фармацевтична промишленост	26 080	3.57%
Акции - Недвижими имоти	25 662	3.52%
Акции - Тежка промишленост	24 084	3.30%
Чуждестранни инвестиции	21 844	2.99%
Корпоративни облигации	245 075	33.58%
Ипотечни облигации	50 707	6.95%
Общински облигации	16 547	2.27%
Банкови депозити	142 568	19.53%
В брой и разплащателни сметки	25 531	3.50%
Вземания*	140 466	19.25%
Общо активи	729 812	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 31/05/2013


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	1 663.99	1.000	\$1 663.99
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	163.445	\$7 518.47
Валутно деноминиран актив	USD	99.00	70.780	\$7 007.22
Обща рискова позиция				\$16 189.68

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 11 000.00	1.289930	\$14 189.23	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$14 189.23		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД