

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 и корпоративни облигации.

Към 31.08.2013г. 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 31.08.2013г. възлиза на 13.98%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 2.82% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 31.08.2013г. корпоративните облигации представляват 35.53% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 2.08% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 19.89% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.08.2013г. са 6.87% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, начислени дивиденди и платени такси към БФБ и КФН възлизат на 18.83% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.08.2013г. е 4.98% на годишна база*, доходността от началото на годината е 4.78%, а доходността за последните 12 месеца към 30.08.2013г. е 5.34%.

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

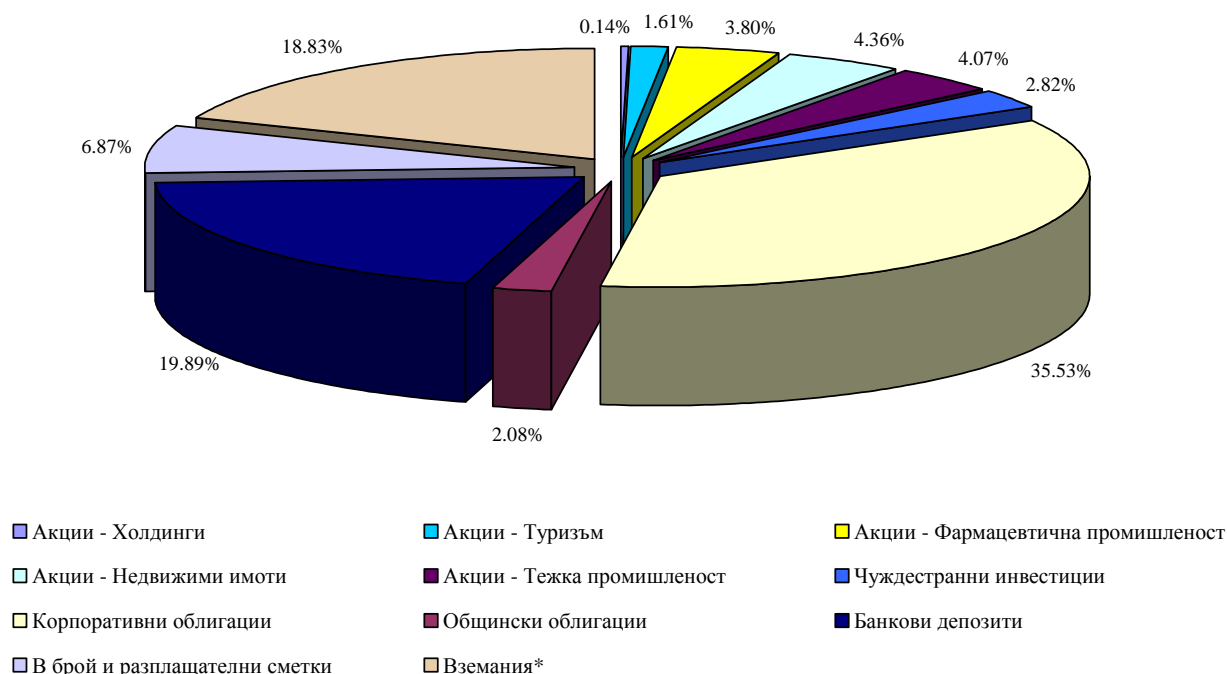
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.08.2013г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 31.08.2013 г.

Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	1 024	0.14%
Акции - Туризм	11 768	1.61%
Акции - Фармацевтична промишленост	27 736	3.80%
Акции - Недвижими имоти	31 781	4.36%
Акции - Тежка промишленост	29 670	4.07%
Чуждестранни инвестиции	20 561	2.82%
Корпоративни облигации	259 131	35.53%
Общински облигации	15 172	2.08%
Банкови депозити	145 049	19.89%
В брой и разплащателни сметки	50 112	6.87%
Вземания*	137 318	18.83%
Общо активи	729 322	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 31/08/2013


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	1 722.96	1.000	\$1 722.96
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	163.650	\$7 527.90
Валутно деноминиран актив	USD	99.00	64.500	\$6 385.50

Обща рискова позиция	\$15 636.36
-----------------------------	-------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 11 000.00	1.327517	\$14 602.69	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$14 602.69		

Красимир Петков
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД