

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 са продадени корпоративни облигации.

Към 31.08.2014г. 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 31.08.2014г. възлиза на 10.62%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 11.82% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 31.08.2014г. корпоративните облигации представляват 24.11% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 1.77% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 18.59% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.08.2014г. са 10.51% 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 22.58% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.08.2014г. е 4.71% на годишна база*, доходността от началото на годината е 2.14%, а доходността за последните 12 месеца към 29.08.2014г. е 2.63%.

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

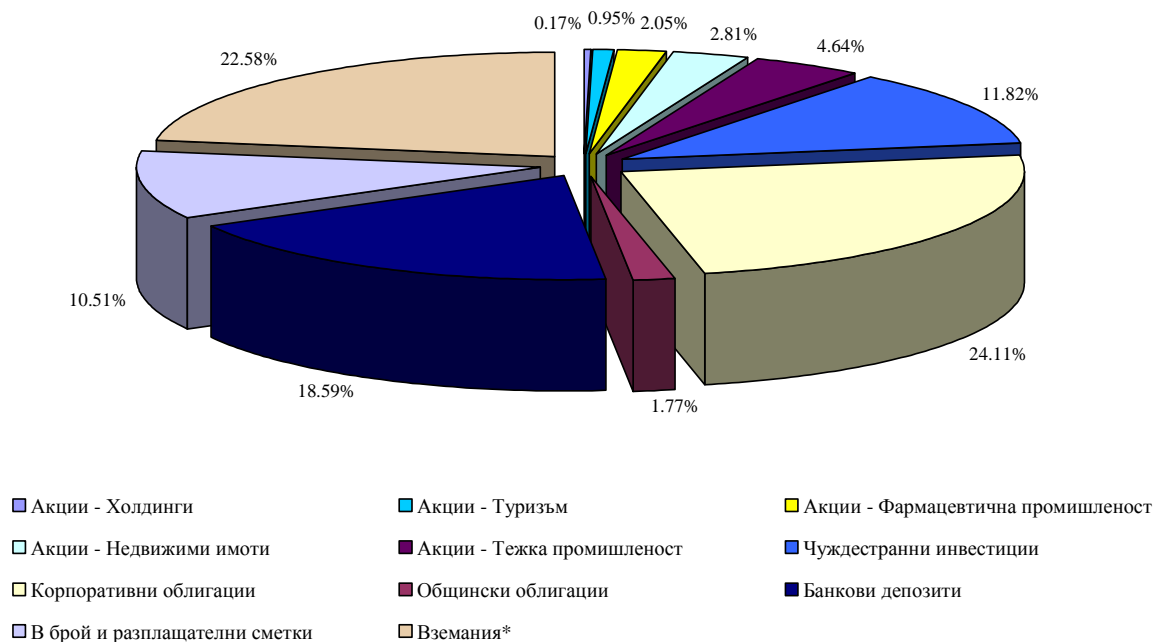
* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.08.2014г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.08.2014 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	1 248	0.17%
Акции - Туризм	7 073	0.95%
Акции - Фармацевтична промишленост	15 270	2.05%
Акции - Недвижими имоти	20 938	2.81%
Акции - Тежка промишленост	34 526	4.64%
Чуждестранни инвестиции	88 001	11.82%
Корпоративни облигации	179 524	24.11%
Общински облигации	13 166	1.77%
Банкови депозити	138 404	18.59%
В брой и разплащателни сметки	78 278	10.51%
Вземания*	168 125	22.58%
Общо активи	744 553	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 31/08/2014



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	465.54	1.000	\$465.54
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	200.710	\$9 232.66
Валутно деноминиран актив	USD	66.00	120.580	\$7 958.28
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	99.780	\$6 086.58

Обща рискова позиция	\$23 743.06
-----------------------------	-------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 16 500.00	1.336380	\$22 050.27	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$22 050.27		

Красимир Петков
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД