

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.

Към 31.10.2014г. 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 31.10.2014г. възлиза на 10.67%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 18.22% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Към 31.10.2014г. корпоративните облигации представляват 25.06% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, а общинските - 1.87% от стойността на активите.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.10.2014г. са 5.31% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, договор и платена такса към КФН възлизат на 38.87% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.10.2014г. е 4.13% на годишна база*, доходността от началото на годината е минус 1.96%, а доходността за последните 12 месеца към 31.10.2014г. е минус 2.20%.

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

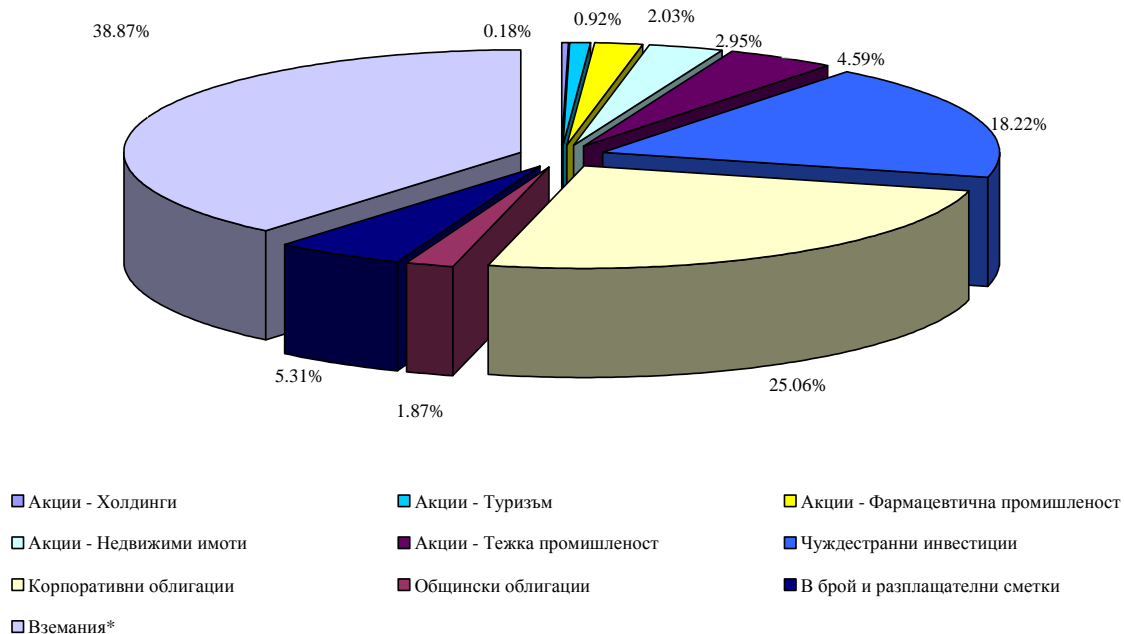
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31.10.2014г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 31.10.2014 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	1 255	0.18%
Акции - Туризм	6 596	0.92%
Акции - Фармацевтична промишленост	14 527	2.03%
Акции - Недвижими имоти	21 037	2.95%
Акции - Тежка промишленост	32 756	4.59%
Чуждестранни инвестиции	130 052	18.22%
Корпоративни облигации	178 878	25.06%
Общински облигации	13 327	1.87%
В брой и разплащателни сметки	37 940	5.31%
Вземания*	277 524	38.87%
Общо активи	713 892	100.00%

* Вземания във връзка с начислени дивиденди, главница и лихви по облигационни емисии, платена такса към КФН и вземания по договор.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 31/10/2014



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	433.08	1.000	\$433.08
Валутно деноминиран актив	USD	46.00	201.660	\$9 276.36
Валутно деноминиран актив	USD	188.00	119.340	\$22 435.92
Валутно деноминиран актив	USD	61.00	101.400	\$6 185.40
Обща рискова позиция				\$38 330.76

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 28 500.00	1.266400	\$36 092.40	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$36 092.40		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД