

**ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО
ЧЛ. 75 Т.2 ОТ НАРЕДБА № 44 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА
КОЛЕКТИВНИТЕ ИНВЕСТИЦИОННИ СХЕМИ, ИНВЕСТИЦИОННИТЕ
ДРУЖЕСТВА ОТ ЗАТВОРЕН ТИП И УПРАВЛЯВАЩИТЕ ДРУЖЕСТВА**

ДОГОВОРЕН ФОНД „ТИ БИ АЙ КОМФОРТ“

I. Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5 от Наредба № 44, във връзка с чл.75 т.2

1) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б „г“: Промени в структурата на портфейла през отчетния период

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 продължават покупките и/или продажбите на акции и облигации от български дружества, търгувани на БФБ – София АД, както и на чуждестранни инвестиции.

Към 30.06.2012г. 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 30.06.2012г. възлиза на 7.03%.

Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 30.06.2012г. възлизат на 5.95% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 13.22% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.06.2012г. са 10.58% от стойността на портфейла.

Към 30.06.2012г. корпоративните облигации представляват 45.92% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт, ипотечните облигации - 4.75%, а общинските 2.17% от стойността на активите.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, начислени дивиденди, хеджиране и предварително платени такси към БФБ възлизат на 10.38% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.06.2012г. е 4.82% на годишна база, доходността от началото на годината е 1.87%, а доходността за последните 12 месеца към 29.06.2012г. е 1.12%.

2) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б. „а” и „д”: Промени в състоянието на активите в рамките на отчетния период

За периода няма записани дялове и обратно са изкупени 822.1856 броя дялове. НСА на фонда към 31.12.2011г. е 779 265.03 лв., а към 30.06.2012г. е 782 660.18 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 57 623.8379.

Долната таблица представя приходите на Фонда към 30.06.2012г. Приходите са в размер на 114 800 лв., включващи приходи от операции с финансови активи, приходи от лихви и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лева		
	30.06.2011	31.12.2011	30.06.2012
Приходи от лихви	31 959	57 160	21 149
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	198 021	251 601	55 799
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	32 133	35 309	35 893
Други финансови приходи	1 746	4 262	1 959
Общо приходи	263 859	348 332	114 800

Разходите на Фонда за отчетния период са представени в таблицата по-долу:

Разходи	Стойност в лева		
	30/06/2011	31/12/2011	30/06/2012
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	178 729	260 233	57 706
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	32 052	35 294	35 100
Други разходи	1 298	2 369	529
Разходи за външни услуги	10 232	18 040	7 085
Общо разходи	222 311	315 936	100 420

Общият размер на разходите на фонда към 30.06.2012г. е 100 420 лева, които включват 57 706 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти, 35 100 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 30.06.2012г. – 4 608 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.42%

б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество

- към 30.06.2012г. – 26 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.00%

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 30.06.2012г. – 1 200 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.11%
- г) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие
 - към 30.06.2012г.– 690 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.06%
- д) Други разходи
 - към 30.06.2012г. – 1 090 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.05%
- Други разходи по финансови операции: 503 лв.
- Външни услуги (КФН, БФБ , ЦД и други услуги): 587 лв.
- е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 7 614 лв. към месец юни 2012. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 0.70%.

	30.06.2011	31.12.2011	30.06.2012
Общо Приходи	263 859	348 332	114 800
Общо Разходи	222 311	315 936	100 420
Нетен Резултат	41 548	32 396	14 380

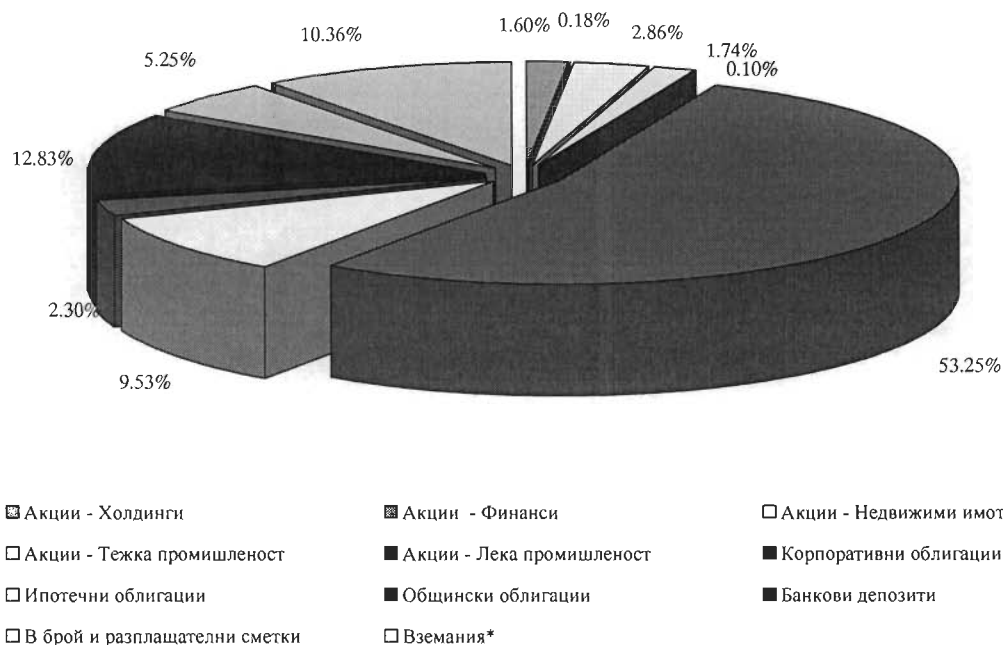
3) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б. „в” и „г”: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт в края на периода е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт

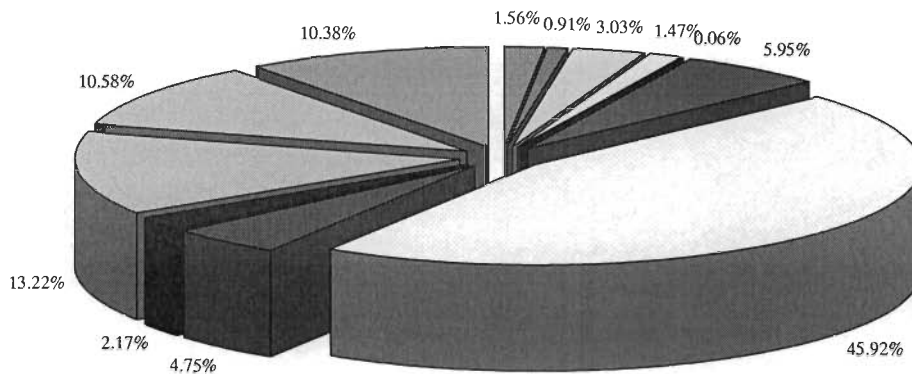
Актив	Стойност в лева 31.12.2011	Процент от активите 31.12.2011	Стойност в лева 30.06.2012	Процент от активите 30.06.2012	Валута (EUR, USD, BGN)
Корпоративни облигации	415 867	53.25%	360 182	45.92%	BGN, EUR
Ипотечни облигации	74 465	9.53%	37 291	4.75%	EUR
Общински облигации	17 999	2.30%	16 984	2.17%	EUR
Банкови депозити	100 197	12.83%	103 714	13.22%	EUR
Акции – Холдинги	12 458	1.60%	12 246	1.56%	BGN
Акции - Недвижими имоти	22 375	2.86%	23 746	3.03%	BGN
Акции - Тежка промишленост	13 620	1.74%	11 555	1.47%	BGN
Акции - Фармацевтична промишленост	0	0.00%	7 168	0.91%	BGN
Акции - Лека промишленост	782	0.10%	495	0.06%	BGN
Акции - Финансов сектор	1 375	0.18%	0	0.00%	BGN
Чуждестранни инвестиции	0	0.00%	46 649	5.95%	USD, EUR
В брой и разплащателни сметки	41 002	5.25%	82 957	10.58%	BGN, EUR, USD
Вземания*	80 906	10.36%	81 407	10.38%	BGN
Обща сума	781 046	100.00%	784 394	100.00%	EUR, USD, BGN

* 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 31/12/2011




Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 30/06/2012



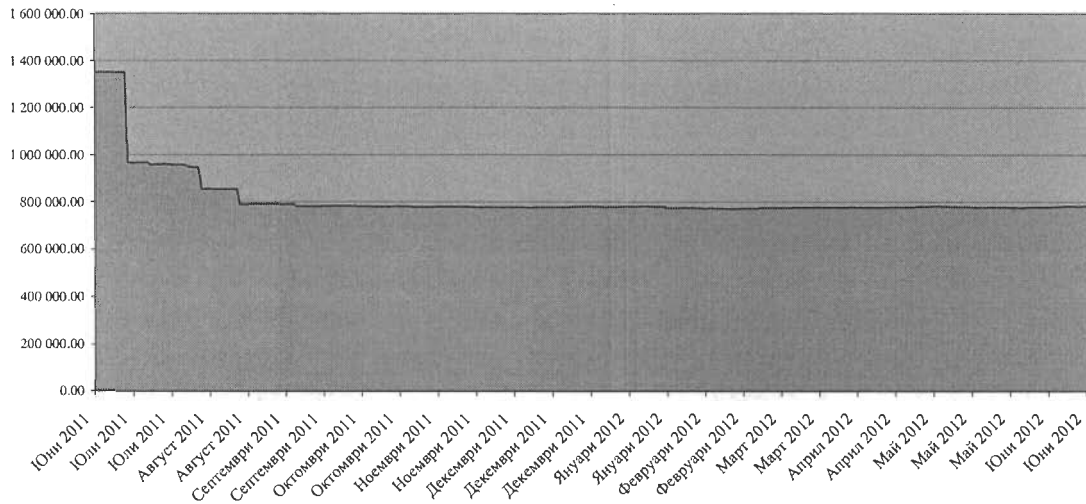
- | | | |
|---|---|--|
| <input type="checkbox"/> Акции - Холдинги | <input type="checkbox"/> Акции - Фармацевтична промишленост | <input type="checkbox"/> Акции - Недвижими имоти |
| <input type="checkbox"/> Акции - Тежка промишленост | <input type="checkbox"/> Акции - Лека промишленост | <input type="checkbox"/> Чуждестранни инвестиции |
| <input type="checkbox"/> Корпоративни облигации | <input type="checkbox"/> Ипотечни облигации | <input type="checkbox"/> Общински облигации |
| <input type="checkbox"/> Банкови депозити | <input type="checkbox"/> В брой и разплащателни сметки | <input type="checkbox"/> Вземания* |

4) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б. „б”: Нетна стойност на активите на един дял

На 30.06.2011г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 13.4565лв. На 31.12.2011г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 13.3331лв.. Към 30.06.2012г. нетната стойност на активите на един дял е 13.5822лв.

Изменението на нетната стойност на активите на Фонда е представено на следващата графика.

Нетна стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт за периода 30/06/2011 - 30/06/2012



Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

