



Асет Менѝджмънт

ИНФОРМАЦИЯ

СЪГЛАСНО ЧЛ. 48 ОТНАРЕДБА № 25 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА ИНВЕСТИЦИОННИТЕ ДРУЖЕСТВА И ДОГОВОРНИ ФОНДОВЕ

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 продадени акции на български компании, корпоративни облигации и чуждестранни акции.

Към 30.05.2008г. корпоративните и общинските облигации представляват 53.74% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Три емисии чуждестранни облигации с експозиция към доходността на различни международни пазари представляват 5.73% от стойността на портфейла на Фонда.

Към 30.05.2008г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 16.51% от общите активи на фонда и дялове на взаимни фондове в размер от 1.28% от общите активи.

Делът на инвестициите в депозити е 19.86% от портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт, като 10% от тези средства са предоставени на краткосрочни депозити във връзка с ограниченията за ликвидност на Фонда.

Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 0.64% от активите на Фонда към 30.05.2008г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.05.2008г. е 14.92% на годишна база*, а доходността за последните 12 месеца към 30.05.2008 г. е 11.51%.

I. Данни по чл. 48, ал. 3 от Наредба № 25

1) Данни по чл. 48, ал. 3 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 30.05.2008г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 30/05/2008		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Корпоративни облигации	4 662 820	53.39%
BG2100014054	226 647	2.60%
BG2100018055	38 403	0.44%
BG2100017040	172 925	1.98%
BG2100036057	288 554	3.30%
BG2100032056	155 640	1.78%
BG2100017065	61 826	0.71%
BG2100027056	29 865	0.34%
BG2100031066	484 153	5.54%
BG2100030068	257 718	2.95%
BG2100037063	281 983	3.23%
BG2100024061	410 466	4.70%

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



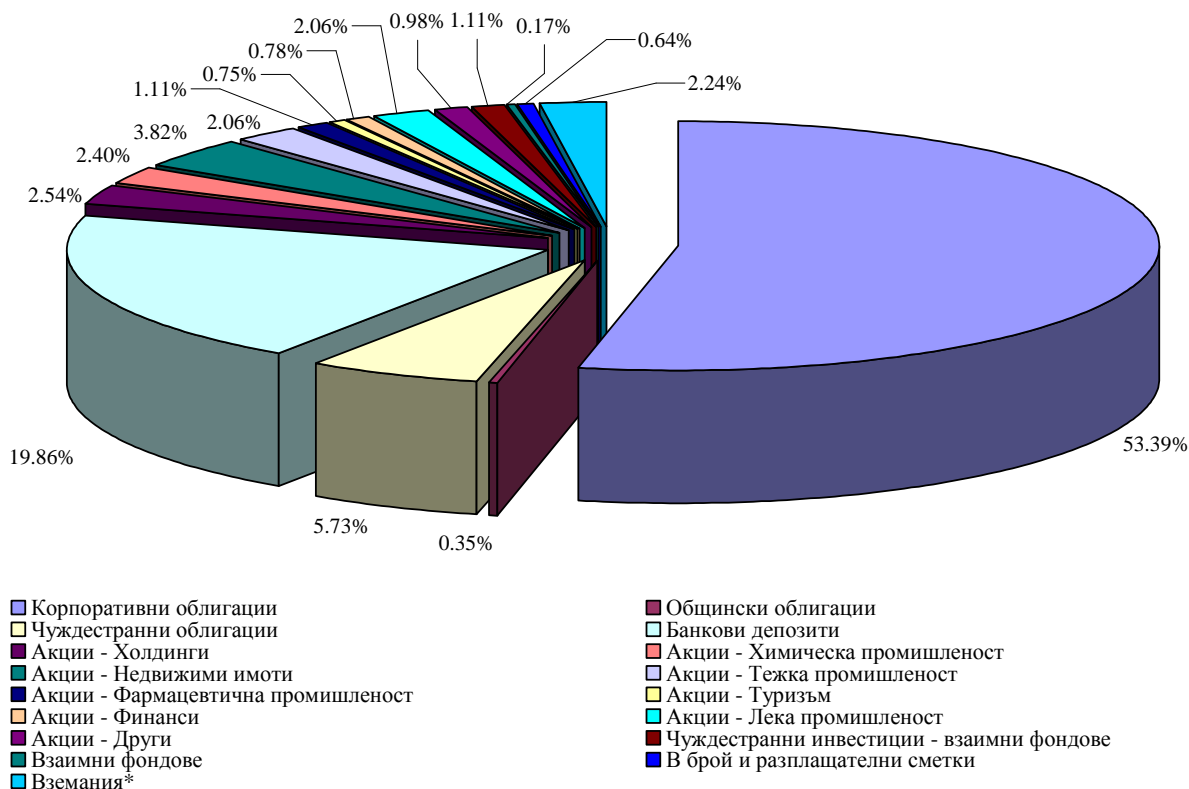
Асет Мениджмънт

BG2100019061	313 165	3.59%
BG2100014062	252 870	2.90%
BG2100001077	337 459	3.86%
BG2100007074	416 012	4.76%
BG2100016075	122 247	1.40%
BG2100019079	153 383	1.76%
BG2100023071	451 415	5.17%
BG2100010078	208 089	2.38%
Общински облигации	30 177	0.35%
BG2100003057	30 177	0.35%
Чуждестранни облигации	500 830	5.73%
DE000SG2J8T5	144 059	1.65%
XS0252187959	96 970	1.11%
XS0301590047	259 801	2.97%
Банкови депозити	1 734 294	19.86%
Акции - Холдинги	222 215	2.54%
BG1100046983	68 302	0.78%
BG1100005971	36 168	0.41%
BG1100019980	61 615	0.71%
BG1100085072	56 130	0.64%
Акции - Химическа промишленост	209 905	2.40%
BG11ORRUAT13	204 385	2.34%
BG11KAGAAT13	5 520	0.06%
Акции - Недвижими имоти	334 034	3.82%
BG1100039061	46 597	0.53%
BG1100030052	17 258	0.20%
BG1100042057	110 374	1.26%
BG1100069068	71 497	0.82%
BG1100109039	68 809	0.79%
BG1100013074	19 500	0.22%
Акции - Фармацевтична промишленост	96 711	1.11%
BG11BAKABT17	59 290	0.68%
BG11SOSOBT18	37 421	0.43%
Акции - Туризм	65 615	0.75%
BG11ALBAAT17	65 615	0.75%
Акции - Тютюнева промишленост	33 992	0.39%
BG11BLBLAT13	11 512	0.13%
BG11SOSOV14	22 480	0.26%
Акции - Тежка промишленост	180 078	2.06%
BG1100075065	142 699	1.63%
BG1100039012	18 524	0.21%
BG11HIYMAT14	10 105	0.12%
BG11MPKAAT18	8 749	0.10%
Акции - Финанси	67 795	0.78%
BG1100129052	49 100	0.56%
BG1100106050	18 695	0.21%
Акции - Лека промишленост	180 003	2.06%
BG11EMSEAT19	8 260	0.09%
BG11DESLAT11	8 155	0.09%
BG1100053070	16 332	0.19%
BG11HELLOAT15	33 412	0.38%
BG1100088076	113 845	1.30%
Акции - Енергетика	51 547	0.59%

	BG1100042073	51 547	0.59%
Чуждестранни инвестиции - взаимни фондове		96 781	1.11%
	LU0168045416	96 781	1.11%
Взаимни фондове		14 858	0.17%
	BG9000004077	14 858	0.17%
В брой и разплащателни сметки		55 805	0.64%
Вземания*		196 047	2.24%
Обща сума		8 733 506	100.00%

* Вземания във връзка с участия в увеличения на капитала, начислени дивиденди и авансово платена такса за поддържане на емисия на БФБ - София АД.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 30/05/2008



2) Данни по чл. 48, ал. 3, т. 2 от Наредба № 25

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.



Асет Мениджмънт

Рисков актив

ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
LU0168045416	USD	185.446	413.808	76 739
XS0301590047	USD	200 000	103.000	206 000

Обща рискова позиция	282 739
----------------------	---------

Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърден договор	EUR/USD	183 000	1.575420	288 302	ОТС	България

Обща хеджираща позиция	288 302
------------------------	---------

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД