



# 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 закупени корпоративни облигации, продадени са акции на български компании, корпоративни и ипотечни облигации, акции на чуждестранни компании, взаимни фондове и чуждестранни облигации.

Към 31.10.2008г. корпоративните, ипотечните и общинските облигации представляват 67.76% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Една емисия чуждестранни облигации с експозиция към доходността на различни развиващи се пазари представляват 1.30% от стойността на портфейла на Фонда.

Към 31.10.2008г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 12.10% от общите активи на фонда и дялове на взаимни фондове в размер от 0.29% от общите активи.

Делът на инвестициите в депозити е 15.91% 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 2.21% от активите на Фонда към 31.10.2008г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.10.2008г. е 8.35% на годишна база\*, а доходността за последните 12 месеца към 31.10.2008 г. е -13.94%.

## 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 31.10.2008г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31/10/2008		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
<b>Корпоративни облигации</b>	<b>3 127 073</b>	<b>62.54%</b>
BG2100017040	127 863	2.56%
BG2100036057	201 844	4.04%
BG2100032056	154 090	3.08%
BG2100017065	62 632	1.25%
BG2100031066	125 040	2.50%
BG2100030068	197 074	3.94%
BG2100037063	290 182	5.80%
BG2100024061	341 417	6.83%
BG2100019061	128 487	2.57%
BG2100014062	194 291	3.89%
BG2100001077	420 673	8.41%
BG2100007074	283 555	5.67%

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

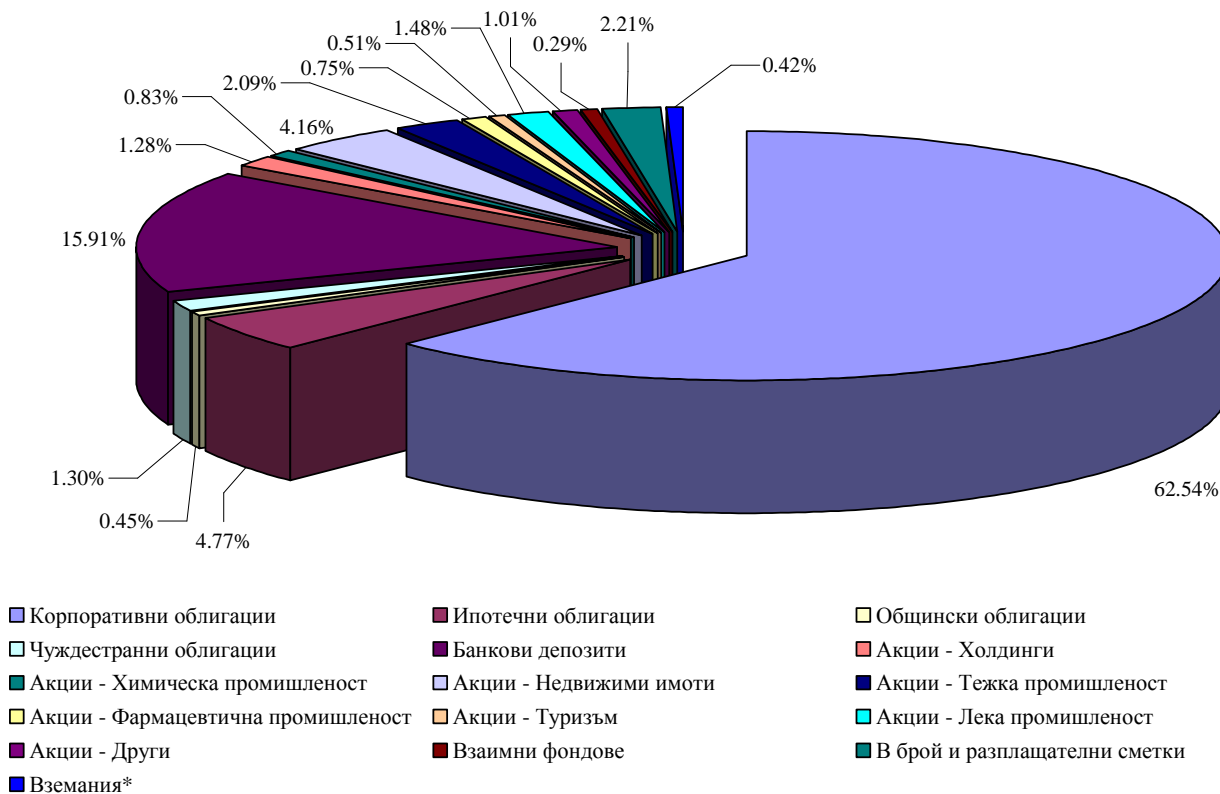


# Асет Мениджмънт

BG2100016075	123 553	2.47%
BG2100019079	91 609	1.83%
BG2100023071	90 829	1.82%
BG2100011084	91 634	1.83%
BG2100016083	97 664	1.95%
BG2100021083	100 609	2.01%
BG2100024087	4 027	0.08%
<b>Ипотечни облигации</b>	<b>238 590</b>	<b>4.77%</b>
BG2100009088	238 590	4.77%
<b>Общински облигации</b>	<b>22 489</b>	<b>0.45%</b>
BG2100003057	22 489	0.45%
<b>Чуждестранни облигации</b>	<b>65 035</b>	<b>1.30%</b>
XS0252187959	65 035	1.30%
<b>Банкови депозити</b>	<b>795 793</b>	<b>15.91%</b>
<b>Акции - Холдинги</b>	<b>64 204</b>	<b>1.28%</b>
BG1100046983	23 319	0.47%
BG1100019980	8 421	0.17%
BG1100085072	32 464	0.65%
<b>Акции - Химическа промишленост</b>	<b>41 319</b>	<b>0.83%</b>
BG11ORRUAT13	41 319	0.83%
<b>Акции - Недвижими имоти</b>	<b>207 828</b>	<b>4.16%</b>
BG1100039061	70 070	1.40%
BG1100042057	37 468	0.75%
BG1100109039	88 665	1.77%
BG1100013074	11 625	0.23%
<b>Акции - Фармацевтична промишленост</b>	<b>37 420</b>	<b>0.75%</b>
BG11BAKABT17	24 755	0.50%
BG11SOSOBT18	12 665	0.25%
<b>Акции - Туризм</b>	<b>25 628</b>	<b>0.51%</b>
BG11ALBAAT17	25 628	0.51%
<b>Акции - Тютюнева промишленост</b>	<b>19 549</b>	<b>0.39%</b>
BG11BLBLAT13	5 499	0.11%
BG11SOSOVT14	14 050	0.28%
<b>Акции - Тежка промишленост</b>	<b>104 487</b>	<b>2.09%</b>
BG1100075065	89 543	1.79%
BG1100039012	2 083	0.04%
BG11MPKAAT18	12 861	0.26%
<b>Акции - Лека промишленост</b>	<b>74 022</b>	<b>1.48%</b>
BG11EMSEAT19	2 992	0.06%
BG1100053070	12 866	0.26%
BG1100088076	58 164	1.16%
<b>Акции - Хранително-вкусова промишленост</b>	<b>11 588</b>	<b>0.23%</b>
BG1100095071	11 588	0.23%
<b>Акции - Енергетика</b>	<b>19 247</b>	<b>0.38%</b>
BG1100042073	19 247	0.38%
<b>Взаимни фондове</b>	<b>14 504</b>	<b>0.29%</b>
BG9000004077	14 504	0.29%
<b>В брой и разплащателни сметки</b>	<b>110 435</b>	<b>2.21%</b>
<b>Вземания*</b>	<b>21 141</b>	<b>0.42%</b>
<b>Обща сума</b>	<b>5 000 350</b>	<b>100.00%</b>

\* Вземания във връзка с начислени дивиденди, продажба на ценни книжа и авансово платена такса за поддържане на емисия на БФБ - София АД.

## Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 31/10/2008



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

Към 31.10.2008 Фондът не притежава активи, деноминирани във валута, различна от лева и евро. Поради тази причина хеджиращата позиция е затворена и сумата на закупените и продадените евра срещу долари към 31.10.2008 е нула, както е посочено в следващата таблица:

### Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърден договор - покупка	EUR/USD	169 000	1.284600	-217 097	ОТС	България
форуърден договор - продажба	EUR/USD	-19 000	1.274775	24 221	ОТС	България
форуърден договор - продажба	EUR/USD	-150 000	1.265425	189 814	ОТС	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>	EUR/USD	0		-3 063		

Стоян Тошев  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД