



Асет Мениджмънт

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 и продадени корпоративни и ипотечни облигации, закупени са акции на български компании.

Към 30.06.2008г. корпоративните, ипотечните и общинските облигации представляват 60.24% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Три емисии чуждестранни облигации с експозиция към доходността на различни международни пазари представляват 5.66% от стойността на портфейла на Фонда.

Към 30.06.2008г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 17.44% от общите активи на фонда и дялове на взаимни фондове в размер от 1.14% от общите активи.

Делът на инвестициите в депозити е 13.09% 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 1.43% от активите на Фонда към 30.06.2008г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.06.2008г. е 13.79% на годишна база*, а доходността за последните 12 месеца към 30.06.2008 г. е 7.88%.

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 30.06.2008г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 30/06/2008		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Корпоративни облигации	4 646 146	55.20%
BG2100014054	227 787	2.71%
BG2100018055	38 628	0.46%
BG2100017040	173 989	2.07%
BG2100036057	278 949	3.31%
BG2100032056	156 556	1.86%
BG2100017065	59 806	0.71%
BG2100027056	30 048	0.36%
BG2100031066	383 481	4.56%
BG2100030068	259 287	3.08%
BG2100037063	283 824	3.37%

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



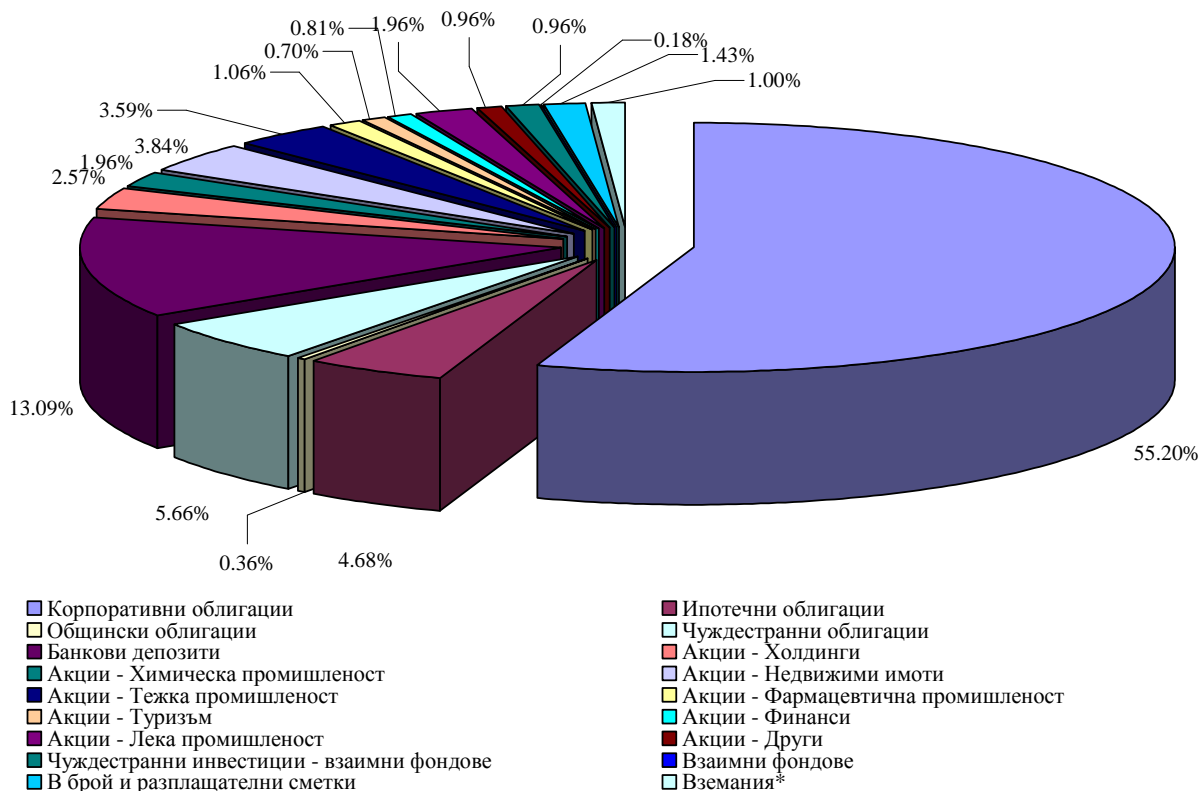
Асет Мениджмънт

BG2100024061	403 973	4.80%
BG2100019061	308 837	3.67%
BG2100014062	253 195	3.01%
BG2100001077	339 468	4.03%
BG2100007074	418 539	4.97%
BG2100016075	123 030	1.46%
BG2100019079	154 413	1.83%
BG2100023071	445 830	5.30%
BG2100010078	209 313	2.49%
BG2100011084	97 193	1.15%
Ипотечни облигации	393 657	4.68%
BG2100009088	393 657	4.68%
Общински облигации	30 352	0.36%
BG2100003057	30 352	0.36%
Чуждестранни облигации	476 479	5.66%
DE000SG2J8T5	135 390	1.61%
XS0252187959	86 127	1.02%
XS0301590047	254 962	3.03%
Банкови депозити	1 101 528	13.09%
Акции - Холдинги	216 664	2.57%
BG1100046983	61 893	0.74%
BG1100005971	31 486	0.37%
BG1100019980	55 834	0.66%
BG1100085072	67 452	0.80%
Акции - Химическа промишленост	165 241	1.96%
BG11ORRUAT13	161 305	1.92%
BG11KAGAAT13	3 936	0.05%
Акции - Недвижими имоти	323 183	3.84%
BG1100039061	45 721	0.54%
BG1100030052	15 614	0.19%
BG1100042057	104 377	1.24%
BG1100069068	72 846	0.87%
BG1100109039	69 775	0.83%
BG1100013074	14 850	0.18%
Акции - Фармацевтична промишленост	89 332	1.06%
BG11BAKABT17	54 179	0.64%
BG11SOSOBT18	35 153	0.42%
Акции - Туризм	58 511	0.70%
BG11ALBAAT17	58 511	0.70%
Акции - Тютюнева промишленост	33 060	0.39%
BG11BLBLAT13	11 985	0.14%
BG11SOSOVT14	21 075	0.25%
Акции - Тежка промишленост	302 065	3.59%
BG1100075065	267 179	3.17%
BG1100039012	17 562	0.21%
BG11HIYMAT14	9 134	0.11%
BG11MPKAAT18	8 190	0.10%
Акции - Финанси	68 220	0.81%
BG1100129052	50 887	0.60%
BG1100106050	17 333	0.21%
Акции - Лека промишленост	164 897	1.96%
BG11EMSEAT19	3 268	0.04%
BG11DESLAT11	7 042	0.08%

BG1100053070	16 920	0.20%
BG11ELLOAT15	29 872	0.35%
BG1100088076	107 794	1.28%
Акции - Енергетика	47 348	0.56%
BG1100042073	47 348	0.56%
Чуждестранни инвестиции - взаимни фондове	80 881	0.96%
LU0168045416	80 881	0.96%
Взаимни фондове	14 821	0.18%
BG9000004077	14 821	0.18%
В брой и разплащателни сметки	120 180	1.43%
Вземания*	83 854	1.00%
Обща сума	8 416 420	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 30/06/2008



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	351.534	65 191
XS0301590047	USD	200 000	102.750	205 500

Обща рискова позиция	270 691
----------------------	---------

Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърден договор	EUR/USD	178 000	1.554300	276 665	ОТС	България

Обща хеджираща позиция	276 665
------------------------	---------

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД