



ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО

ЧЛ. 48 и ЧЛ. 73Г ОТ НАРЕДБА № 25 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА ИНВЕСТИЦИОННИТЕ ДРУЖЕСТВА И ДОГОВОРНИ ФОНДОВЕ ЗА ДОГОВОРЕН ФОНД „ТИ БИ АЙ КОМФОРТ”

I. Данни по чл. 73г, ал. 1, т. 6 от Наредба № 25

1) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, 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 са закупени акции на български и чуждестранни компании, корпоративни и ипотечни облигации, продадени са акции на български и чуждестранни компании, дялове на взаимни фондове и корпоративни и ипотечни облигации.

Към 30.09.2008г. корпоративните, ипотечните и общинските облигации представляват 60.80% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Три емисии чуждестранни облигации с експозиция към доходността на различни международни пазари представляват 6.62% от стойността на портфейла на Фонда.

Към 30.09.2008г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 14.53% от общите активи на фонда и дялове на взаимни фондове в размер от 0.66% от общите активи. Чуждестранните акции представляват 0.40% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Делът на инвестициите в депозити е 15.57% 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 0.84% от активите на Фонда към 30.09.2008г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.09.2008г. е 10.58% на годишна база*, а доходността за последните 12 месеца към 30.09.2008 г. е -6.92%.

2) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „а” и „д”: Промени в състоянието на активите в рамките на отчетния период

Долната таблица представя приходите на Фонда към 30.09.2008г. Приходите са в размер на 3 087 971 лева, включващи преценка от операции с финансови активи, приходи от лихви, положителни курсови разлики и други финансови приходи.

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



Приходи	Стойност в лева		
	31/03/2008	30/06/2008	30/09/2008
Приходи от лихви	143 300	265 148	382 151
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	956 465	1 686 351	2 351 602
Положителни курсови разлики	105 809	207 962	335 981
Други финансови приходи	0	14 977	18 237
Общо приходи:	1 205 574	2 174 438	3 087 971

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

Разходи	Стойност в лева		
	31/03/2007	30/06/2007	30/09/2007
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	1 385 952	2 278 309	3 399 513
Отрицателни курсови разлики	103 590	204 095	331 264
Разходи за външни услуги	31 559	58 699	83 711
Други финансови разходи	318	913	2 555
Общо разходи:	1 521 419	2 542 016	3 817 044

Общият размер на разходите на фонда към 30.09.2008г. е 3 817 044 лева, които включват 3 399 513 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и отрицателни валутни курсови разлики в размер на 331 264 лева.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 30 септември 2008 – 80 223 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.91%

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

- към 30 септември 2008 – 1 022 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.012%

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 30 септември 2008 – 2 093 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.02%

г) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие

- към 30 септември 2008 – 720 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.01%

д) Други разходи

- към 30 септември 2008 – 2 208 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.03%

- Други разходи по финансови операции: 1533 лв.

- Външни услуги (КФН и БФБ): 675 лв.



е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 86 267 лв. към месец септември. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 0.98%.

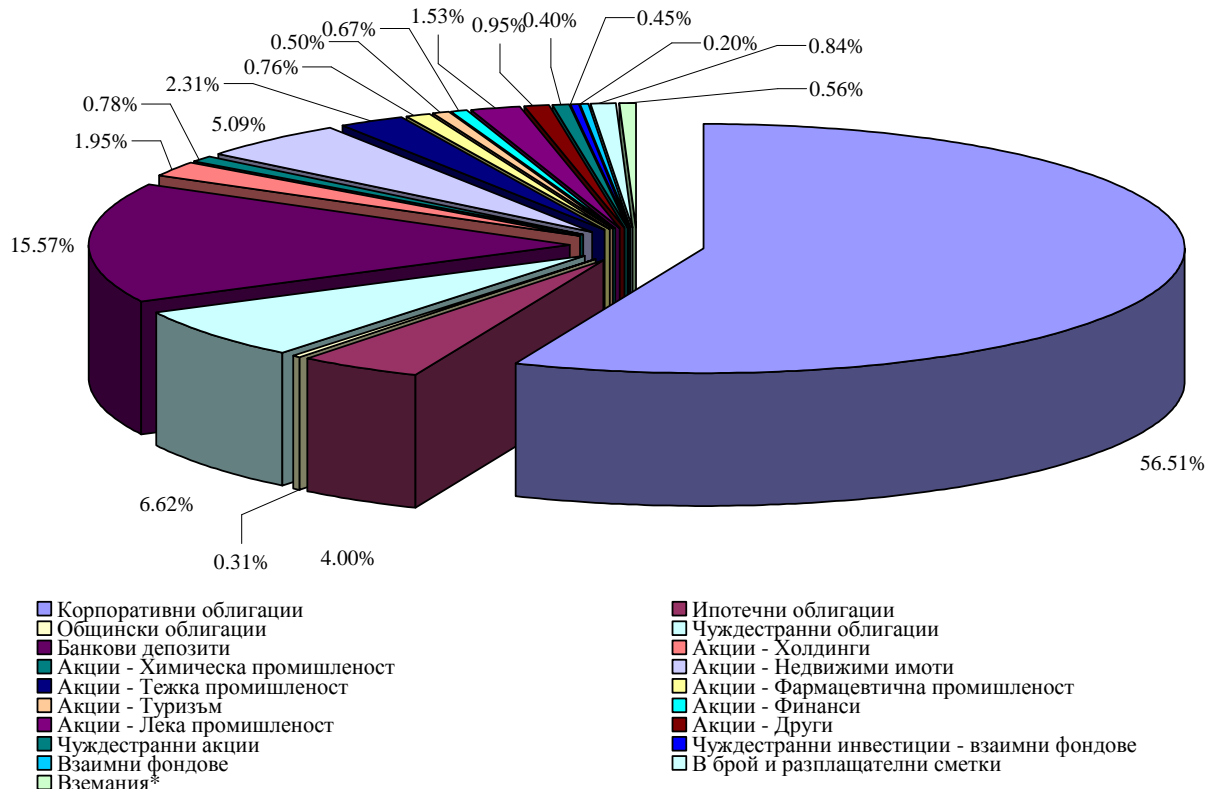
3) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „в“: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

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 към 30/09/2008		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Корпоративни облигации	4 112 204	56.51%
Ипотечни облигации	291 391	4.00%
Общински облигации	22 254	0.31%
Чуждестранни облигации	481 617	6.62%
Банкови депозити	1 133 321	15.57%
Акции - Холдинги	141 825	1.95%
Акции - Химическа промишленост	56 499	0.78%
Акции - Недвижими имоти	370 147	5.09%
Акции - Тежка промишленост	168 256	2.31%
Акции - Фармацевтична промишленост	55 188	0.76%
Акции - Туризм	36 044	0.50%
Акции - Финанси	48 893	0.67%
Акции - Лека промишленост	111 268	1.53%
Акции - Други	69 092	0.95%
Чуждестранни акции	29 374	0.40%
Чуждестранни инвестиции - взаимни фондове	33 026	0.45%
Взаимни фондове	14 672	0.20%
В брой и разплащателни сметки	61 176	0.84%
Вземания*	40 793	0.56%
Обща сума	7 277 041	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 30/09/2008



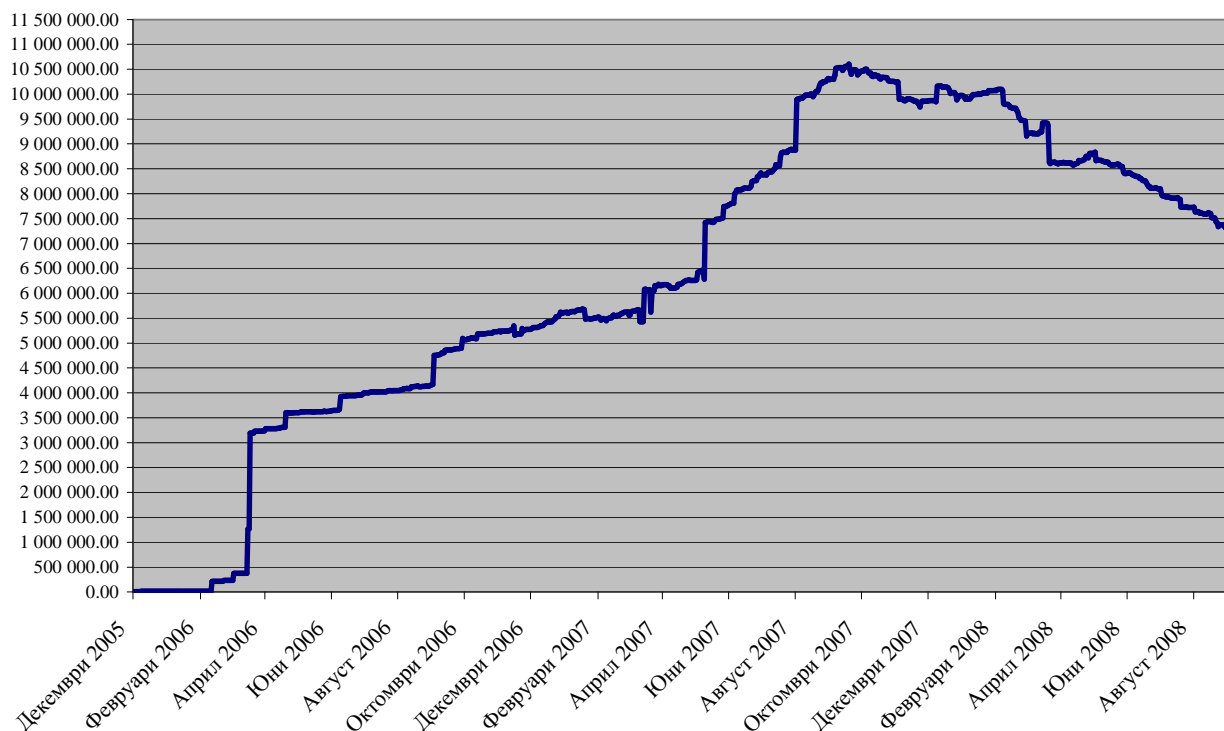
4) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „б“: Нетна стойност на активите на един дял

НСА на фонда към 30.06.2008 е 8 406 107.30 лева, а към 30.09.2008г. е 7 257 862.19 лв.
 На 30.06.2008 г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 13.8287 лв.
 Към 30.09.2008 г. нетната стойност на активите на един дял е 13.2012 лв.

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 са записани 353.3238 дяла и са обратно изкупени 58 438.4096 дяла.
Броят дялове към края на отчетния период е 549 787.1855.

II. Данни по чл. 48, ал. 3, т. 2 от 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	92.446	261.252	24 152
XS0301590047	USD	200 000	101.250	202 500
US6778621044	USD	200.000	56.200	11 240
US3682872078	USD	350.000	29.260	10 241

Обща рискова позиция	248 133
-----------------------------	----------------

Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърден договор	EUR/USD	171 000	1.472230	251 751	OTC	България

Обща хеджираща позиция	251 751
-------------------------------	----------------

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД