



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 акции на български компании и ипотечни облигации, продадени са акции на български компании, дялове на взаимни фондове и корпоративни облигации.

Към 31.07.2008г. корпоративните, ипотечните и общинските облигации представляват 60.86% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Три емисии чуждестранни облигации с експозиция към доходността на различни международни пазари представляват 5.94% от стойността на портфейла на Фонда.

Към 31.07.2008г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 16.04% от общите активи на фонда и дялове на взаимни фондове в размер от 0.70% от общите активи.

Делът на инвестициите в депозити е 15.49% 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 0.38% от активите на Фонда към 31.07.2008г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.07.2008г. е 12.39% на годишна база*, а доходността за последните 12 месеца към 31.07.2008 г. е 2.40%.

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 31.07.2008г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31/07/2008		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Корпоративни облигации	4 410 665	55.47%
BG2100018055	36 816	0.46%
BG2100017040	174 043	2.19%
BG2100036057	277 043	3.48%
BG2100032056	157 567	1.98%
BG2100017065	60 206	0.76%
BG2100027056	29 582	0.37%
BG2100031066	385 528	4.85%
BG2100030068	255 182	3.21%
BG2100037063	284 437	3.58%
BG2100024061	407 526	5.13%

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



Асет Мениджмънт

BG2100019061	311 037	3.91%
BG2100014062	252 815	3.18%
BG2100001077	339 518	4.27%
BG2100007074	410 954	5.17%
BG2100016075	118 094	1.49%
BG2100019079	153 388	1.93%
BG2100023071	448 577	5.64%
BG2100010078	210 086	2.64%
BG2100011084	98 265	1.24%
Ипотечни облигации	398 514	5.01%
BG2100009088	396 528	4.99%
BG2100011035	1 986	0.02%
Общински облигации	30 535	0.38%
BG2100003057	30 535	0.38%
Чуждестранни облигации	472 116	5.94%
DE000SG2J8T5	131 729	1.66%
XS0252187959	83 553	1.05%
XS0301590047	256 834	3.23%
Банкови депозити	1 231 612	15.49%
Акции - Холдинги	185 980	2.34%
BG1100046983	44 845	0.56%
BG1100005971	26 644	0.34%
BG1100019980	50 117	0.63%
BG1100085072	64 374	0.81%
Акции - Химическа промишленост	84 715	1.07%
BG11ORRUAT13	81 942	1.03%
BG11KAGAAT13	2 773	0.03%
Акции - Недвижими имоти	361 222	4.54%
BG1100039061	90 145	1.13%
BG1100030052	13 975	0.18%
BG1100042057	98 154	1.23%
BG1100069068	72 509	0.91%
BG1100109039	72 189	0.91%
BG1100013074	14 250	0.18%
Акции - Фармацевтична промишленост	72 938	0.92%
BG11BAKABT17	44 416	0.56%
BG11SOSOBT18	28 521	0.36%
Акции - Туризм	41 809	0.53%
BG11ALBAAT17	41 809	0.53%
Акции - Тютюнева промишленост	32 094	0.40%
BG11BLBLAT13	10 387	0.13%
BG11SOSOV14	21 707	0.27%
Акции - Тежка промишленост	270 060	3.40%
BG1100075065	243 033	3.06%
BG1100039012	13 077	0.16%
BG11HIYMAT14	7 863	0.10%
BG11MPKAAT18	6 087	0.08%
Акции - Финанси	86 047	1.08%
BG1100129052	71 209	0.90%
BG1100106050	14 838	0.19%
Акции - Лека промишленост	82 021	1.03%
BG11EMSEAT19	6 701	0.08%
BG11DESLAT11	5 969	0.08%

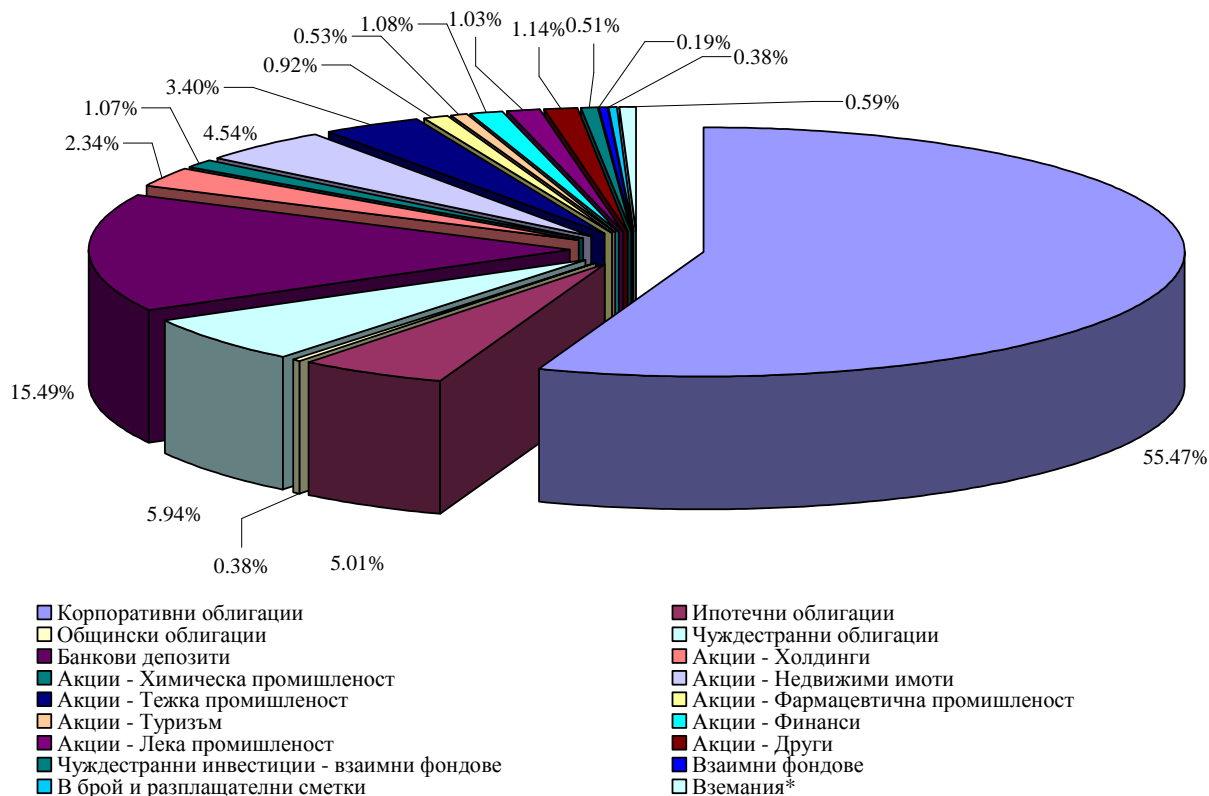


Асет Мениджмънт

BG1100053070	12 645	0.16%
BG11ELLOAT15	20 737	0.26%
BG1100088076	35 970	0.45%
Акции - Хранително-вкусова промишленост	15 050	0.19%
BG1100095071	15 050	0.19%
Акции - Енергетика	43 298	0.54%
BG1100042073	43 298	0.54%
Чуждестранни инвестиции - взаимни фондове	40 822	0.51%
LU0168045416	40 822	0.51%
Взаимни фондове	14 754	0.19%
BG9000004077	14 754	0.19%
В брой и разплащателни сметки	30 206	0.38%
Вземания*	46 515	0.59%
Обща сума	7 950 973	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 31/07/2008



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	92.446	352.461	32 584
XS0301590047	USD	200 000	102.500	205 000

Обща рискова позиция	237 584
----------------------	---------

Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърден договор	EUR/USD	153 000	1.573350	240 723	OTC	България

Обща хеджираща позиция	240 723
------------------------	---------

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД