



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

Към 29.08.2008г. корпоративните, ипотечните и общинските облигации представляват 61.91% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Три емисии чуждестранни облигации с експозиция към доходността на различни международни пазари представляват 6.35% от стойността на портфейла на Фонда.

Към 29.08.2008г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 16.63% от общите активи на фонда и дялове на взаимни фондове в размер от 0.71% от общите активи. Чуждестранните акции представляват 0.51% от активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Делът на инвестициите в депозити е 13.56% 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 0.26% от активите на Фонда към 29.08.2008г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.08.2008г. е 12.07% на годишна база*, а доходността за последните 12 месеца към 29.08.2008 г. е 0.41%.

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 29.08.2008г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 29/08/2008		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Корпоративни облигации	4 404 966	57.58%
BG2100017040	135 764	1.77%
BG2100036057	270 463	3.54%
BG2100032056	152 313	1.99%
BG2100017065	59 798	0.78%
BG2100027056	29 731	0.39%
BG2100031066	364 051	4.76%
BG2100030068	243 802	3.19%
BG2100037063	286 202	3.74%
BG2100024061	398 786	5.21%
BG2100019061	304 611	3.98%

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



Асет Мениджмънт

BG2100014062	245 472	3.21%
BG2100001077	328 971	4.30%
BG2100007074	413 346	5.40%
BG2100016075	122 549	1.60%
BG2100019079	101 912	1.33%
BG2100023071	448 596	5.86%
BG2100010078	211 269	2.76%
BG2100011084	90 450	1.18%
BG2100016083	98 307	1.28%
BG2100021083	98 572	1.29%
Ипотечни облигации	301 045	3.93%
BG2100009088	299 048	3.91%
BG2100011035	1 997	0.03%
Общински облигации	30 698	0.40%
BG2100003057	30 698	0.40%
Чуждестранни облигации	485 430	6.35%
DE000SG2J8T5	134 921	1.76%
XS0252187959	77 740	1.02%
XS0301590047	272 768	3.57%
Банкови депозити	1 037 157	13.56%
Акции - Холдинги	176 977	2.31%
BG1100046983	43 099	0.56%
BG1100005971	22 519	0.29%
BG1100019980	49 737	0.65%
BG1100085072	61 622	0.81%
Акции - Химическа промишленост	85 746	1.12%
BG11ORRUAT13	83 115	1.09%
BG11KAGAAT13	2 631	0.03%
Акции - Недвижими имоти	354 030	4.63%
BG1100039061	91 406	1.19%
BG1100030052	14 587	0.19%
BG1100042057	86 557	1.13%
BG1100069068	72 576	0.95%
BG1100109039	74 630	0.98%
BG1100013074	14 274	0.19%
Акции - Фармацевтична промишленост	66 571	0.87%
BG11BAKABT17	40 762	0.53%
BG11SOSOBT18	25 810	0.34%
Акции - Туризъм	47 892	0.63%
BG11ALBAAT17	47 892	0.63%
Акции - Тютюнева промишленост	29 051	0.38%
BG11BLBLAT13	10 164	0.13%
BG11SOSOV14	18 887	0.25%
Акции - Тежка промишленост	278 478	3.64%
BG1100075065	253 375	3.31%
BG1100039012	12 115	0.16%
BG11HIYMAT14	7 087	0.09%
BG11MPKAAT18	5 901	0.08%
Акции - Финанси	50 503	0.66%
BG1100129052	35 730	0.47%
BG1100106050	14 772	0.19%
Акции - Лека промишленост	123 386	1.61%
BG11EMSEAT19	4 603	0.06%

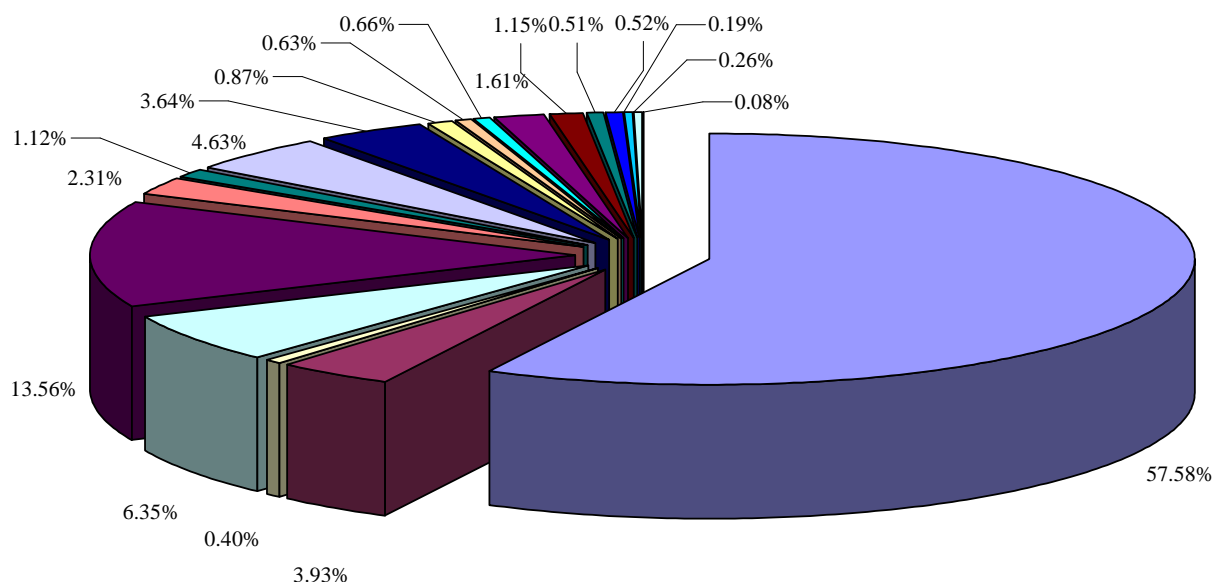


Асет Мениджмънт

BG11DESLAT11	2 651	0.03%
BG1100053070	12 459	0.16%
BG11ELLOAT15	20 967	0.27%
BG1100088076	82 706	1.08%
Акции - Хранително-вкусова промишленост	14 420	0.19%
BG1100095071	14 420	0.19%
Акции - Енергетика	44 857	0.59%
BG1100042073	44 857	0.59%
Чуждестранни акции	38 673	0.51%
US6778621044	20 308	0.27%
US3682872078	18 364	0.24%
Чуждестранни инвестиции - взаимни фондове	39 755	0.52%
LU0168045416	39 755	0.52%
Взаимни фондове	14 729	0.19%
BG9000004077	14 729	0.19%
В брой и разплащателни сметки	20 222	0.26%
Вземания*	5 896	0.08%
Обща сума	7 650 481	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 29/08/2008



- Корпоративни облигации
- Общински облигации
- Банкови депозити
- Акции - Химическа промишленост
- Акции - Тежка промишленост
- Акции - Туризм
- Акции - Лека промишленост
- Чуждестранни акции
- Взаимни фондове
- Вземания*
- Ипотечни облигации
- Чуждестранни облигации
- Акции - Холдинги
- Акции - Недвижими имоти
- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Финанси
- Акции - Други
- Чуждестранни инвестиции - взаимни фондове
- В брой и разплащателни сметки



Асет Мениджмънт

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.

Рисков актив

ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
LU0168045416	USD	92.446	323.981	29 951
XS0301590047	USD	200 000	102.750	205 500
US6778621044	USD	200.000	76.500	15 300
US3682872078	USD	350.000	39.530	13 836

Обща рискова позиция	264 586
-----------------------------	----------------

Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърден договор	EUR/USD	171 000	1.476040	252 403	OTC	България

Обща хеджираща позиция	252 403
-------------------------------	----------------

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД