



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 и продадени корпоративни облигации, продадени са общински облигации, закупени са и са продадени акции на български публични дружества, закупени са дялове на договорни фондове.

Към 30.04.2008г. корпоративните и общинските облигации представляват 58.17% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Три емисии чуждестранни облигации с експозиция към доходността на различни международни пазари представляват 5.84% от стойността на портфейла на Фонда.

Към 30.04.2008г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 17.58% от общите активи на фонда и дялове на взаимни фондове в размер от 1.33% от общите активи. Акции на чуждестранни компании към 30.04.2008г. представляват 0.15% от активите на Фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 16.40% 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 0.32% от активите на Фонда към 30.04.2008г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.04.2008г. е 15.00% на годишна база*, а доходността за последните 12 месеца към 30.04.2008 г. е 13.20%.

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 30.04.2008г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 30/04/2008		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Корпоративни облигации	5 000 683	57.82%
BG2100014054	225 448	2.61%
BG2100018055	38 185	0.44%
BG2100017040	171 894	1.99%
BG2100036057	286 853	3.32%
BG2100032056	160 787	1.86%
BG2100017065	61 451	0.71%
BG2100027056	29 698	0.34%
BG2100031066	481 289	5.56%
BG2100030068	256 200	2.96%
BG2100037063	291 831	3.37%

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



Асет Мениджмънт

BG2100024061	407 970	4.72%
BG2100019061	311 171	3.60%
BG2100014062	259 814	3.00%
BG2100001077	467 693	5.41%
BG2100007074	413 583	4.78%
BG2100016075	121 438	1.40%
BG2100019079	152 390	1.76%
BG2100023071	648 180	7.49%
BG2100010078	214 807	2.48%
Общински облигации	30 006	0.35%
BG2100003057	30 006	0.35%
Чуждестранни облигации	504 820	5.84%
DE000SG2J8T5	146 593	1.70%
XS0252187959	95 812	1.11%
XS0301590047	262 414	3.03%
Банкови депозити	1 418 163	16.40%
Акции - Холдинги	206 976	2.39%
BG1100046983	67 878	0.78%
BG1100005971	32 239	0.37%
BG1100019980	62 343	0.72%
BG1100085072	44 516	0.51%
Акции - Химическа промишленост	214 396	2.48%
BG11ORRUAT13	209 148	2.42%
BG11KAGAAT13	5 248	0.06%
Акции - Недвижими имоти	327 841	3.79%
BG1100039061	47 297	0.55%
BG1100030052	18 003	0.21%
BG1100042057	94 506	1.09%
BG1100069068	75 597	0.87%
BG1100109039	72 189	0.83%
BG1100013074	20 250	0.23%
Акции - Фармацевтична промишленост	89 410	1.03%
BG11BAKABT17	52 636	0.61%
BG11SOSOBT18	36 774	0.43%
Акции - Туризм	63 343	0.73%
BG11ALBAAT17	63 343	0.73%
Акции - Тютюнева промишленост	31 512	0.36%
BG11BLBLAT13	11 139	0.13%
BG11SOSOV14	20 373	0.24%
Акции - Тежка промишленост	300 453	3.47%
BG1100075065	263 909	3.05%
BG1100039012	19 185	0.22%
BG11HIYMAT14	8 980	0.10%
BG11MPKAAT18	8 379	0.10%
Акции - Финанси	65 490	0.76%
BG1100129052	46 870	0.54%
BG1100106050	18 620	0.22%
Акции - Лека промишленост	173 437	2.01%
BG11EMSEAT19	7 668	0.09%
BG11DESLAT11	7 095	0.08%
BG1100053070	17 174	0.20%
BG11HELLOAT15	33 982	0.39%
BG1100088076	107 518	1.24%

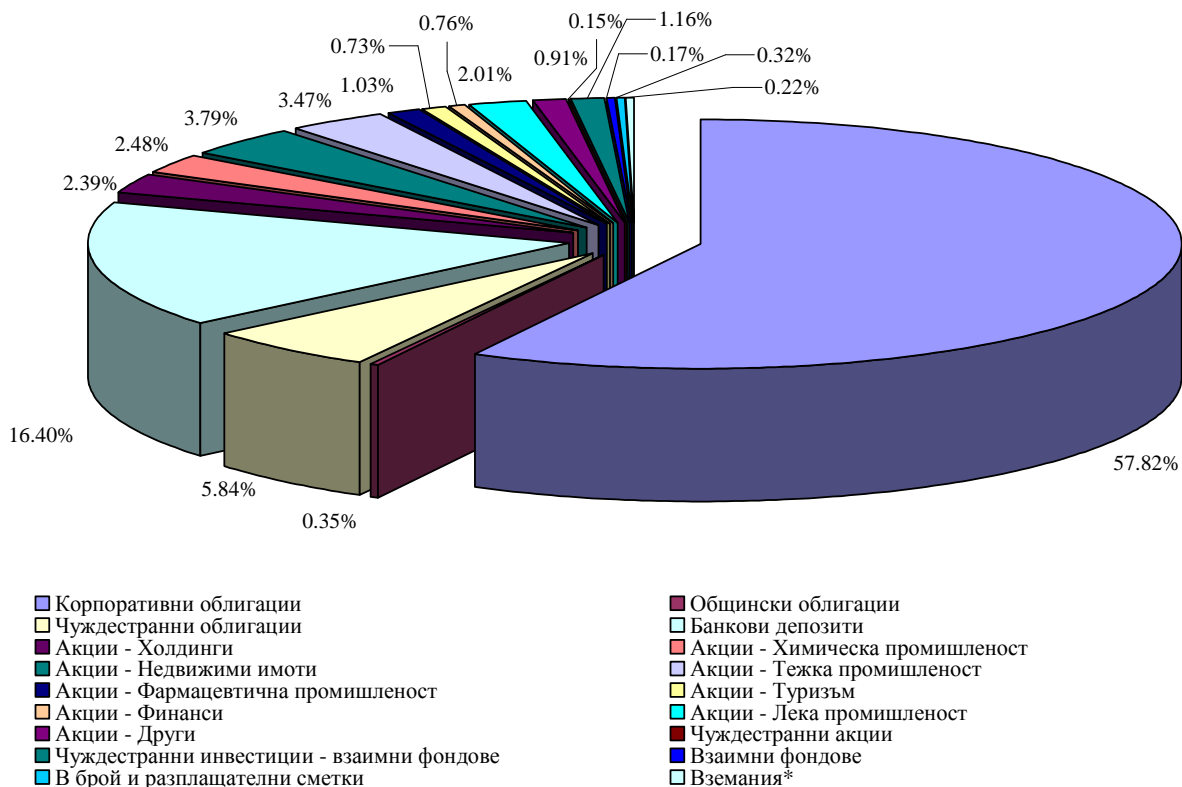


Асет Мениджмънт

Акции - Енергетика		47 541	0.55%
	BG1100042073	47 541	0.55%
Чуждестранни акции		13 261	0.15%
	US3682872078	13 261	0.15%
Чуждестранни инвестиции - взаимни фондове		99 953	1.16%
	LU0168045416	99 953	1.16%
Взаимни фондове		14 806	0.17%
	BG9000004077	14 806	0.17%
В брой и разплащателни сметки		27 404	0.32%
Вземания*		19 060	0.22%
Обща сума		8 648 553	100.00%

* Вземания във връзка с участия в увеличения на капитала, продажба на права и авансово платена такса за поддържане на емисия на БФБ - София АД.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 30/04/2008



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	428.246	79 417
US3682872078	USD	800	13.170	10 536
XS0301590047	USD	200 000	104.250	208 500

Обща рискова позиция	298 453
-----------------------------	---------

Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърден договор	EUR/USD	192 500	1.592410	306 539	OTC	България

Обща хеджираща позиция	306 539
-------------------------------	---------

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД