

**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 и са закупени и продадени акции на български публични дружества.

Към 30.11.2007г. корпоративните и общинските облигации представляват 53.51% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Три емисии чуждестранни ценни книжа с експозиция към доходността на различни международни пазари представляват 5.38% от стойността на портфейла на Фонда.

Към 30.11.2007г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 16.16% от общите активи на фонда и дялове на взаимни фондове с експозиция към чуждестранни пазари в размер от 1.29% от общите активи. Акции на чуждестранни компании към 30.11.2007г. представляват 0.13% от активите на Фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 21.88% 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 0.40% от активите на Фонда към 30.11.2007г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.11.2007г. е 20.78% на годишна база*, а доходността за последните 12 месеца към 30.11.07 г. е 26.87%.

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 30.11.2007г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 30/11/2007		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Корпоративни облигации	5 483 869	53.05%
BG2100014054	227 129	2.20%
BG2100002034	196 847	1.90%
BG2100018055	38 896	0.38%
BG2100017040	198 895	1.92%
BG2100036057	286 410	2.77%
BG2100032056	155 972	1.51%
BG2100017065	62 006	0.60%
BG2100027056	60 298	0.58%
BG2100031066	486 385	4.71%

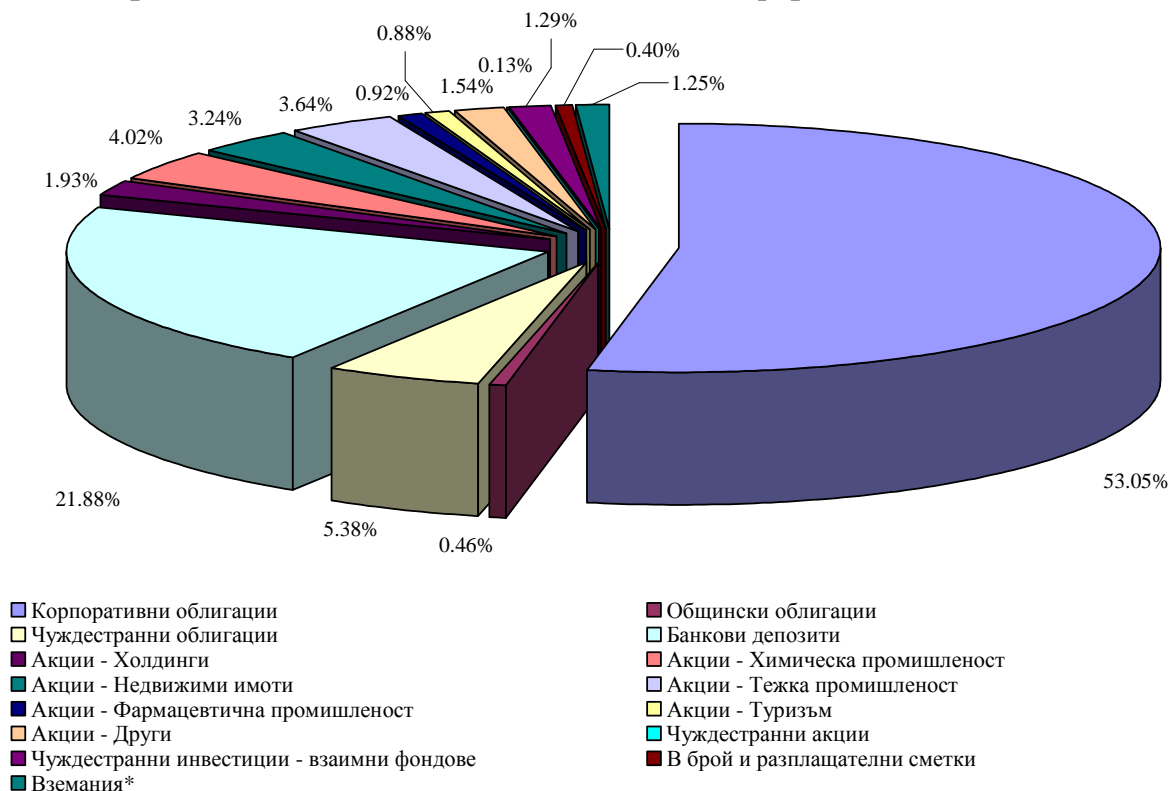
* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

BG2100030068	258 856	2.50%
BG2100001051	30 529	0.30%
BG2100037063	282 281	2.73%
BG2100024061	414 306	4.01%
BG2100019061	312 816	3.03%
BG2100014062	252 142	2.44%
BG2100001077	468 470	4.53%
BG2100007074	416 250	4.03%
BG2100016075	121 182	1.17%
BG2100019079	353 715	3.42%
BG2100023071	652 446	6.31%
BG2100010078	208 039	2.01%
Общински облигации	47 546	0.46%
BG2100007041	8 456	0.08%
BG2100003057	39 090	0.38%
Чуждестранни облигации	556 168	5.38%
DE000SG2J8T5	177 433	1.72%
XS0252187959	109 495	1.06%
XS0301590047	269 240	2.60%
Банкови депозити	2 261 493	21.88%
Акции - Холдинги	199 070	1.93%
BG1100046983	104 516	1.01%
BG1100005971	55 586	0.54%
BG1100019980	38 968	0.38%
Акции - Химическа промишленост	415 133	4.02%
BG11ORRUAT13	403 310	3.90%
BG11KAGAAT13	11 823	0.11%
Акции - Недвижими имоти	335 155	3.24%
BG1100039061	47 297	0.46%
BG1100030052	17 230	0.17%
BG1100042057	129 825	1.26%
BG1100069068	64 992	0.63%
BG1100109039	75 811	0.73%
Акции - Фармацевтична промишленост	94 897	0.92%
BG11BAKABT17	41 890	0.41%
BG11SOSOBT18	53 006	0.51%
Акции - Туризм	91 143	0.88%
BG11ALBAAT17	91 143	0.88%
Акции - Тютюнева промишленост	36 505	0.35%
BG11BLBLAT13	12 620	0.12%
BG11SOSOV14	23 885	0.23%
Акции - Тежка промишленост	376 016	3.64%
BG1100075065	334 599	3.24%
BG1100039012	30 152	0.29%
BG11HIYMAT14	11 264	0.11%
Акции - Финанси	60 407	0.58%
BG1100129052	60 407	0.58%
Акции - Лека промишленост	62 371	0.60%
BG11EMSEAT19	10 573	0.10%
BG11DESLAT11	14 382	0.14%
BG1100053070	17 382	0.17%
BG11ELLOAT15	20 035	0.19%
Чуждестранни акции	13 769	0.13%
US3682872078	13 769	0.13%
Чуждестранни инвестиции - взаимни фондове	133 088	1.29%
LU0168045416	133 088	1.29%
В брой и разплащателни сметки	41 348	0.40%
Вземания*	128 715	1.25%
Обща сума	10 336 693	100.00%

* Вземания във връзка с участието в увеличението на капитала на четири дружества, лихвено плащане по емисия корпоративни облигации, амортизационно плащане по емисия облигации

и авансово платена такса за поддържане на емисия на БФБ - София АД.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 30/11/2007



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	185.446	541.635	100 444
US3682872078	USD	800	12.990	10 392
XS0301590047	USD	200 000	104.200	208 400

Обща рискова позиция	319 236
-----------------------------	----------------

Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърден договор	EUR/USD	217 200	1.4850	322 542	OTC	България

Обща хеджираща позиция	322 542
-------------------------------	----------------

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД