

**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 и на чуждестранни компании.

Към 31.10.2007г. корпоративните и общинските облигации представляват 54.70% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Четири емисии чуждестранни ценни книжа с експозиция към доходността на различни международни пазари представляват 6.48% от стойността на портфейла на Фонда.

Към 31.10.2007г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 19.39% от общите активи на фонда и дялове на взаимни фондове с експозиция към чуждестранни пазари в размер от 1.54% от общите активи. Ациите на чуждестранни компании към 31.10.2007г. представляват 0.13% от активите на Фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 17.24% 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 0.43% от активите на Фонда към 31.10.2007г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.10.2007г. е 22.78% на годишна база*, а доходността за последните 12 месеца към 31.10.07 г. е 30.42%.

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 31.10.2007г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31/10/2007		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Корпоративни облигации	5 701 103	54.23%
BG2100014054	184 777	1.76%
BG2100002034	195 680	1.86%
BG2100018055	38 679	0.37%
BG2100017040	157 184	1.50%
BG2100036057	435 329	4.14%
BG2100032056	160 234	1.52%
BG2100017065	62 007	0.59%

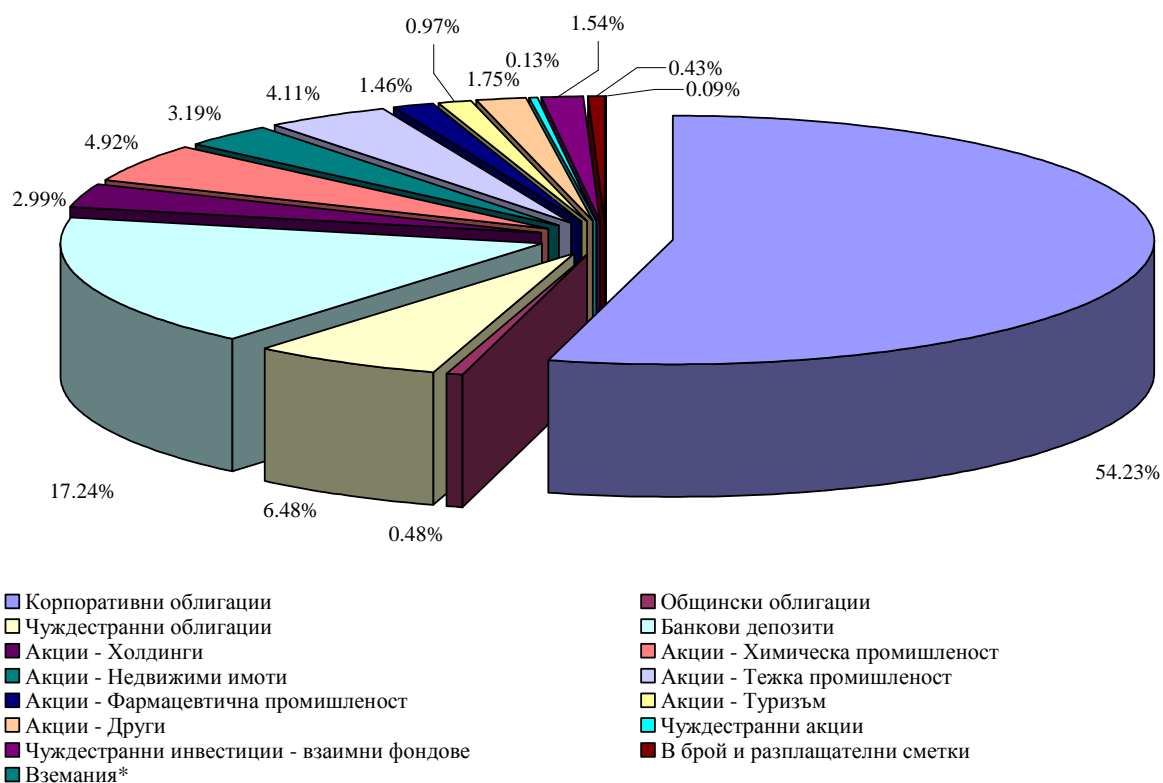
* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

BG2100027056	59 937	0.57%
BG2100031066	483 437	4.60%
BG2100030068	257 289	2.45%
BG2100001051	30 358	0.29%
BG2100037063	290 569	2.76%
BG2100024061	411 811	3.92%
BG2100019061	460 085	4.38%
BG2100014062	257 481	2.45%
BG2100001077	465 715	4.43%
BG2100007074	413 821	3.94%
BG2100016075	120 380	1.15%
BG2100019079	352 925	3.36%
BG2100023071	648 579	6.17%
BG2100010078	214 826	2.04%
Общински облигации	50 013	0.48%
BG2100007041	11 096	0.11%
BG2100003057	38 917	0.37%
Чуждестранни облигации	680 948	6.48%
DE000SG2J8T5	183 754	1.75%
XS0252187959	110 958	1.06%
XS0304994337	99 014	0.94%
XS0301590047	287 222	2.73%
Банкови депозити	1 812 939	17.24%
Акции - Холдинги	314 579	2.99%
BG1100046983	116 077	1.10%
BG1100005971	84 838	0.81%
BG1100019980	48 727	0.46%
BG4000028077	64 938	0.62%
Акции - Химическа промишленост	517 613	4.92%
BG11ORRUAT13	482 242	4.59%
BG11KAGAAT13	35 371	0.34%
Акции - Недвижими имоти	335 030	3.19%
BG1100039061	46 246	0.44%
BG1100030052	16 708	0.16%
BG1100042057	129 825	1.23%
BG1100069068	64 992	0.62%
BG1100109039	77 259	0.73%
Акции - Фармацевтична промишленост	153 638	1.46%
BG11BAKABT17	49 453	0.47%
BG11SOSOBT18	65 532	0.62%
BG4000027079	38 653	0.37%
Акции - Туризм	101 650	0.97%
BG11ALBAAT17	101 650	0.97%
Акции - Тютюнева промишленост	40 445	0.38%
BG11BLBLAT13	15 155	0.14%
BG11SOSOV14	25 290	0.24%
Акции - Тежка промишленост	432 503	4.11%
BG1100075065	366 140	3.48%
BG1100039012	53 927	0.51%
BG11HIYMAT14	12 436	0.12%
Акции - Финанси	64 295	0.61%
BG1100129052	64 295	0.61%
Акции - Лека промишленост	79 215	0.75%

BG11EMSEAT19	12 397	0.12%
BG11DESLAT11	26 119	0.25%
BG1100053070	19 585	0.19%
BG11ELLOAT15	20 890	0.20%
BG4000030073	224	0.00%
Чуждестранни акции	13 280	0.13%
US3682872078	13 280	0.13%
Чуждестранни инвестиции - взаимни фондове	161 567	1.54%
LU0168045416	161 567	1.54%
В брой и разплащателни сметки	45 213	0.43%
Вземания*	8 970	0.09%
Обща сума	10 513 003	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 31/10/2007



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	643.549	119 344
US3682872078	USD	800	12.262	9 810
XS0301590047	USD	200 000	106.080	212 160

Обща рискова позиция	341 313
-----------------------------	----------------

Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърден договор	EUR/USD	222 000	1.4157	314 279	OTC	България
форуърден договор	EUR/USD	12 000	1.4377	17 252	OTC	България

Обща хеджираща позиция	331 531
-------------------------------	----------------

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД