

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

Към 28.12.2007г. корпоративните и общинските облигации представляват 55.96% 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 5.65% от стойността на портфейла на Фонда.

Към 28.12.2007г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 16.37% от общите активи на фонда и дялове на взаимни фондове с експозиция към чуждестранни пазари в размер от 1.32% от общите активи. Акции на чуждестранни компании към 28.12.2007г. представляват 0.16% от активите на Фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 17.39% 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 28.12.2007г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 28.12.2007г. е 19.79% на годишна база*, а доходността за последните 12 месеца към 28.12.2007 г. е 25.09%.

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 28.12.2007г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 28/12/2007		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Корпоративни облигации	5 487 423	55.49%
BG2100014054	228 329	2.31%
BG2100002034	197 836	2.00%
BG2100018055	39 107	0.40%
BG2100017040	200 060	2.02%
BG2100036057	279 748	2.83%
BG2100032056	156 893	1.59%
BG2100017065	59 948	0.61%
BG2100027056	60 680	0.61%
BG2100031066	489 197	4.95%

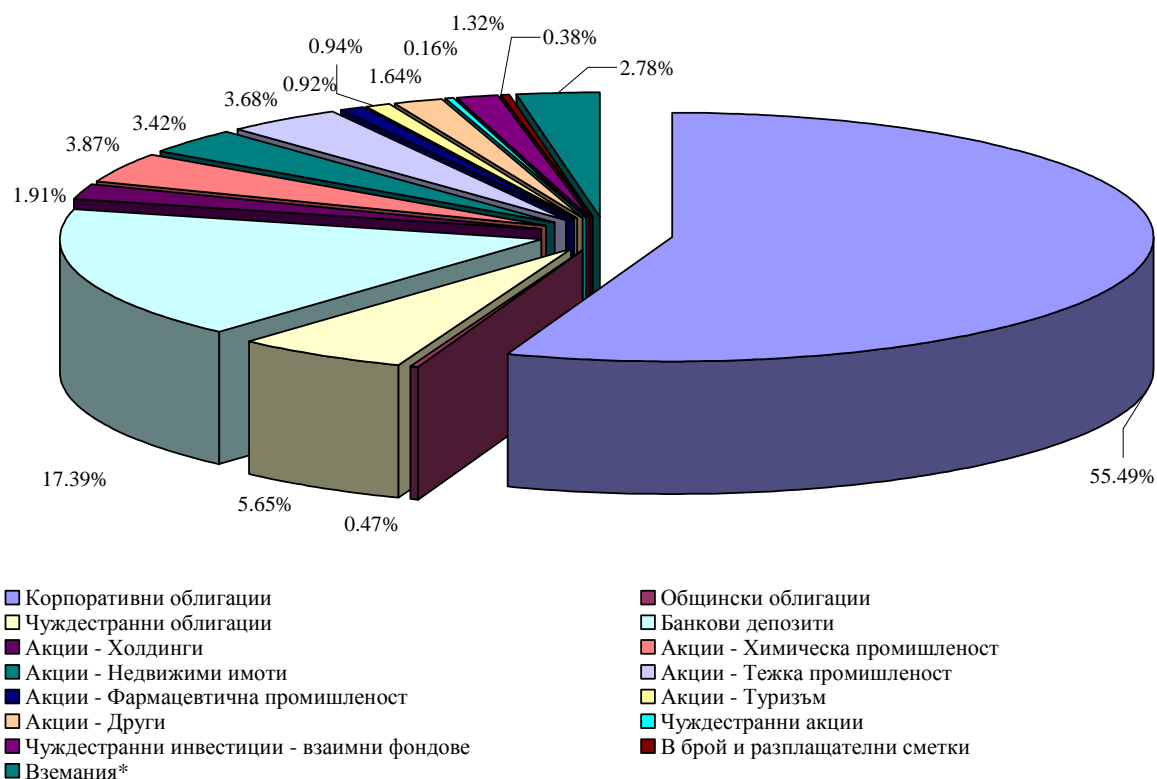
* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

BG2100030068	260 341	2.63%
BG2100001051	30 696	0.31%
BG2100037063	284 014	2.87%
BG2100024061	416 715	4.21%
BG2100019061	309 692	3.13%
BG2100014062	252 805	2.56%
BG2100001077	471 060	4.76%
BG2100007074	418 531	4.23%
BG2100016075	122 380	1.24%
BG2100019079	356 041	3.60%
BG2100023071	644 167	6.51%
BG2100010078	209 183	2.12%
Общински облигации	46 202	0.47%
BG2100007041	8 133	0.08%
BG2100003057	38 069	0.38%
Чуждестранни облигации	558 400	5.65%
DE000SG2J8T5	182 409	1.84%
XS0252187959	107 751	1.09%
XS0301590047	268 241	2.71%
Банкови депозити	1 719 696	17.39%
Акции - Холдинги	189 203	1.91%
BG1100046983	99 783	1.01%
BG1100005971	51 907	0.52%
BG1100019980	37 513	0.38%
Акции - Химическа промишленост	382 945	3.87%
BG11ORRUAT13	369 702	3.74%
BG11KAGAAT13	13 243	0.13%
Акции - Недвижими имоти	337 737	3.42%
BG1100039061	47 297	0.48%
BG1100030052	17 418	0.18%
BG1100042057	125 743	1.27%
BG1100069068	69 054	0.70%
BG1100109039	78 225	0.79%
Акции - Фармацевтична промишленост	91 290	0.92%
BG11BAKABT17	38 253	0.39%
BG11SOSOBT18	53 037	0.54%
Акции - Туризм	92 648	0.94%
BG11ALBAAT17	92 648	0.94%
Акции - Тютюнева промишленост	36 574	0.37%
BG11BLBLAT13	12 689	0.13%
BG11SOSOV14	23 885	0.24%
Акции - Тежка промишленост	363 516	3.68%
BG1100075065	323 997	3.28%
BG1100039012	29 163	0.29%
BG11HIYMAT14	10 356	0.10%
Акции - Финанси	60 307	0.61%
BG1100129052	60 307	0.61%
Акции - Лека промишленост	64 935	0.66%
BG11EMSEAT19	9 668	0.10%
BG11DESLAT11	14 142	0.14%
BG1100053070	16 862	0.17%
BG11ELLOAT15	24 263	0.25%
Чуждестранни акции	15 373	0.16%

US3682872078	15 373	0.16%
Чуждестранни инвестиции - взаимни фондове	130 060	1.32%
LU0168045416	130 060	1.32%
В брой и разплащателни сметки	38 025	0.38%
Вземания*	274 826	2.78%
Обща сума	9 889 160	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 28/12/2007



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	526.838	97 700
US3682872078	USD	800	14.435	11 548
XS0301590047	USD	200 000	100.750	201 500

Обща рискова позиция	310 748
-----------------------------	----------------

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