
**ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО ЧЛ. 18 ОТ НАРЕДБА № 26 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ
ДЕЙНОСТТА НА УПРАВЛЯВАЩИТЕ ДРУЖЕСТВА
ЗА ДОГОВОРЕН ФОНД „ТИ БИ АЙ КОМФОРТ”**

I. Данни по чл. 18, ал. 1

1) Данни по чл. 18, ал. 1 т. 1: Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

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 и са закупени/продадени акции на публични дружества на БФБ – София АД.

Към 29.09.2006г. корпоративните и общинските облигации представляват 32.50% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт.

Две емисии чуждестранни ценни книжа с експозиция към доходността на акции на международни компании - сини чипове и на компании на развиващите се пазари представляват 5.16 % от стойността на портфейла на Фонда.

Към 29.09.2006г. договорният фонд притежава акции, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 15.64% от общите активи на фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 45.33% 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, а останалите са предоставени на краткосрочни депозити докато бъдат инвестирани в ценни книжа.

Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 0.54 % от активите на Фонда към 29.09.2006г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.09.2006г. е 14.24% на годишна база*.

2) Данни по чл. 18, ал. 1 т. 2: Стойност на портфейла в началото и в края на отчетния период

През отчетния период стойността на портфейла на Фонда се увеличава от 4 087 172 лева към 31.08.2006г. до 4 770 085 лева към 29.09.2006г.

3) Данни по чл. 18, ал. 1 т. 3: Извършени разходи по управление на дейността или портфейла през отчетния период

Разходите на Фонда за отчетния период са представени в таблицата по-долу:

Общият размер на разходите на фонда към 29.09.2006г. е 278 970 лева, които включват 254 166 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и

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

отрицателни валутни курсови разлики в размер на 329 лева. Последните не са част от “всички разходи, свързани с дейността на дружеството” по чл. 171 ЗППЦК.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 29 септември 2006 – 20 484 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.85%

б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество

- към 29 септември 2006 – 195 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.008%

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 29 септември 2006 – 1000 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.04%

г) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие

- към 29 септември 2006 – 261 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.01%

д) Други разходи

- към 29 септември 2006 – 2 535 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.11%

- Други разходи по финансови операции: 2069 лв.

- Външни услуги (КФН): 466 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 24 475 лв. към месец септември. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 1.02%.

4) Приходи от управление на дейността или портфейла през отчетния период

Долната таблица представя приходите на Фонда към 29.09.2006г. Приходите са в размер на 438 360 лева, включващи преоценка от операции с финансови активи и приходи от лихви и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лева		
	31/07/2006	31/08/2006	29/09/2006
Приходи от лихви	50 479	66 307	82 669
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	155 461	257 394	351 704
Други финансови приходи	2 593	3 986	3 986
Общо приходи:	208 533	327 687	438 360

II. Данни по чл. 18, ал. 2

1) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла в началото и в края на отчетния период

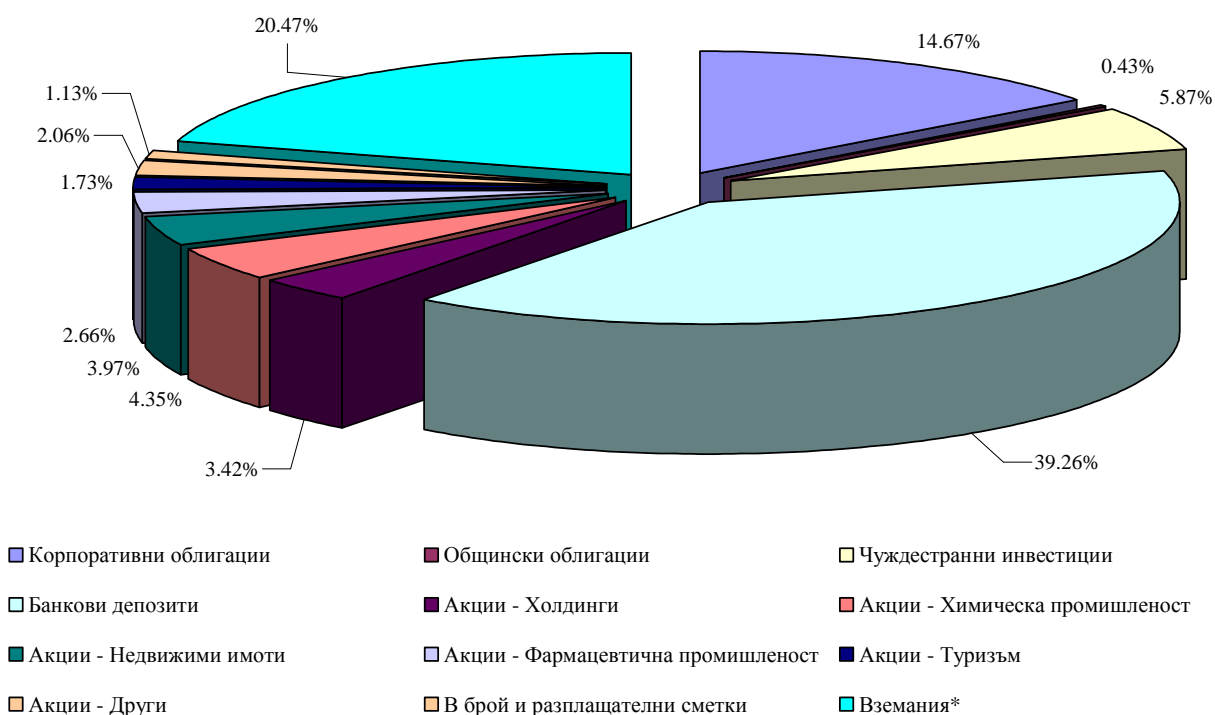
Структурата и обема на инвестициите в портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт в началото на периода са представени в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31/08/2006		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Корпоративни облигации	599,790	14.67%
BG2100014054	20,466	0.50%
BG2100002034	4,177	0.10%
BG2100007058	13,826	0.34%
BG2100018055	38,457	0.94%
BG2100017040	18,911	0.46%
BG 2100036057	140,840	3.45%
BG2100032056	302,655	7.40%
BG2100017065	60,458	1.48%
Общински облигации	17,527	0.43%
BG2100005029	1,025	0.03%
BG2100007041	16,502	0.40%
Чуждестранни инвестиции	239,785	5.87%
DE000SG2J8T5	158,720	3.88%
XS0252187959	81,065	1.98%
Банкови депозити	1,604,442	39.26%
Акции - Холдинги	139,892	3.42%
BG1100046983	73,432	1.80%
BG1100019980	66,460	1.63%
Акции - Химическа промишленост	177,741	4.35%
BG11ORRUAT13	177,741	4.35%
Акции - Недвижими имоти	162,130	3.97%
BG1100025052	6,048	0.15%
BG1100019055	17,176	0.42%
BG1100030052	706	0.02%
BG1100042057	54,108	1.32%
BG1100109039	76,230	1.87%
BG4000033069	7,862	0.19%
Акции - Фармацевтична промишленост	108,575	2.66%
BG11BAKABT17	46,175	1.13%
BG11SOSOBT18	62,399	1.53%
Акции - Туризм	70,785	1.73%
BG11ALBAAT17	70,785	1.73%
Акции - Тютюнева промишленост	34,285	0.84%
BG11BLBLAT13	12,367	0.30%
BG11SOSOVT14	21,918	0.54%
Акции - Телекомуникации	33,924	0.83%
BG1100005997	33,924	0.83%
Акции - Финанси	15,782	0.39%
BG1100098059	15,782	0.39%

В брой и разплащателни сметки	46,000	1.13%
Вземания*	836,515	20.47%
Обща сума	4,087,172	100.00%

* Вземания във връзка с начислени дивиденди и падеж на депозит, от който паричните средства постъпват на следващия ден - 01/09/2006.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 31/08/2006

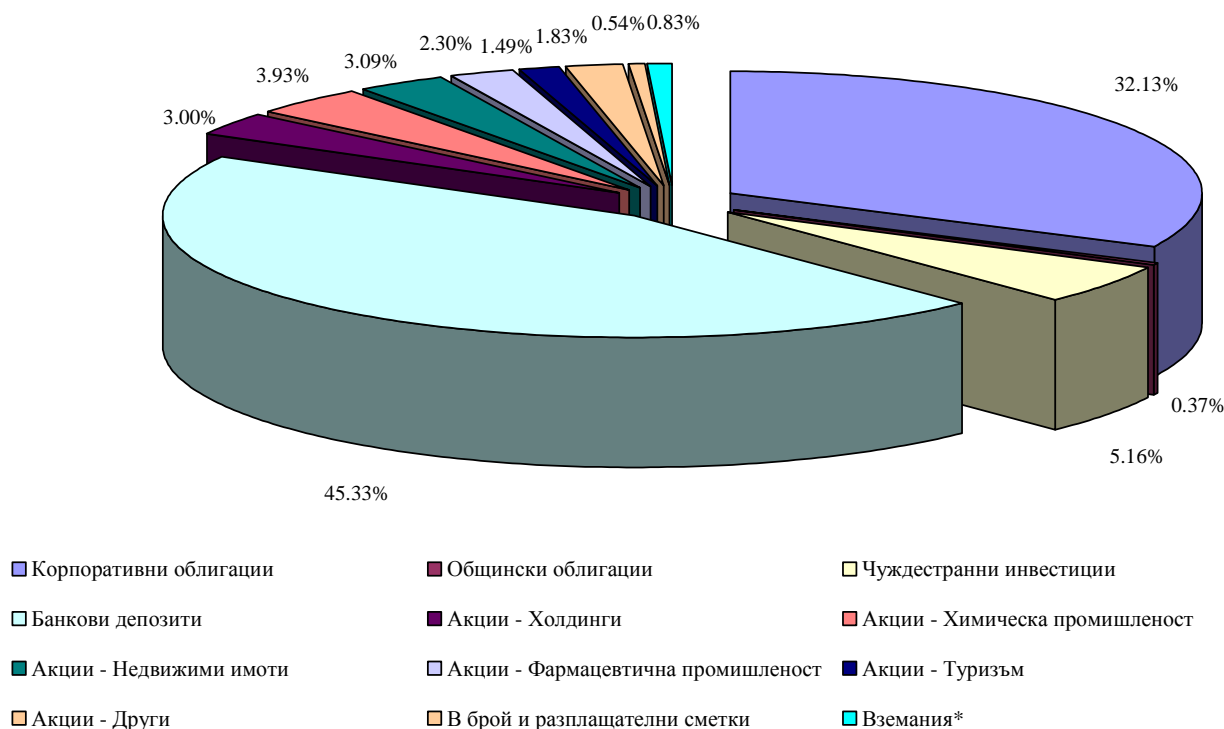


Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт в края на периода е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 29/09/2006		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Корпоративни облигации	1 532 841	32.13%
BG2100014054	72 000	1.51%
BG2100002034	148 120	3.11%
BG2100007058	129 270	2.71%
BG2100018055	38 647	0.81%
BG2100017040	73 108	1.53%
BG2100036057	182 031	3.82%
BG2100032056	304 228	6.38%
BG2100014062	303 122	6.35%
BG2100017065	60 823	1.28%
BG2100027056	60 116	1.26%
BG2100031066	59 703	1.25%
BG2100024061	101 673	2.13%
Общински облигации	17 615	0.37%
BG2100005029	1 031	0.02%
BG2100007041	16 584	0.35%
Чуждестранни инвестиции	245 973	5.16%
DE000SG2J8T5	163 977	3.44%
XS0252187959	81 996	1.72%
Банкови депозити	2 162 177	45.33%
Акции - Холдинги	143 023	3.00%
BG1100046983	75 076	1.57%
BG1100019980	67 947	1.42%
Акции - Химическа промишленост	187 346	3.93%
BG11ORRUAT13	187 346	3.93%
Акции - Недвижими имоти	147 364	3.09%
BG1100025052	6 192	0.13%
BG1100019055	18 028	0.38%
BG1100030052	726	0.02%
BG1100042057	49 083	1.03%
BG1100109039	73 335	1.54%
Акции - Фармацевтична промишленост	109 834	2.30%
BG11BAKABT17	47 144	0.99%
BG11SOSOBT18	62 690	1.31%
Акции - Туризъм	70 940	1.49%
BG11ALBAAT17	70 940	1.49%
Акции - Тютюнева промишленост	34 413	0.72%
BG11BLBLAT13	12 633	0.26%
BG11SOSOVV14	21 780	0.46%
Акции - Телекомуникации	37 024	0.78%
BG1100005997	37 024	0.78%
Акции - Финанси	15 998	0.34%
BG1100098059	15 998	0.34%
В брой и разплащателни сметки	25 995	0.54%
Вземания*	39 540	0.83%
Обща сума	4 770 085	100.00%

* Вземания във връзка със записването на акции от увеличението на капитала на дружество, търгувано на БФБ-София АД, продажба на права и авансово платена такса на КФН.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 30/09/2006



2) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 2: Финансово състояние на другите активи на Фонда в началото и края на периода

Към 31 август 2006г. друг актив на Фонда представлява вземане във връзка с начислени дивиденди и падеж на депозит, от който паричните средства постъпват на следващия ден - 01/09/2006.

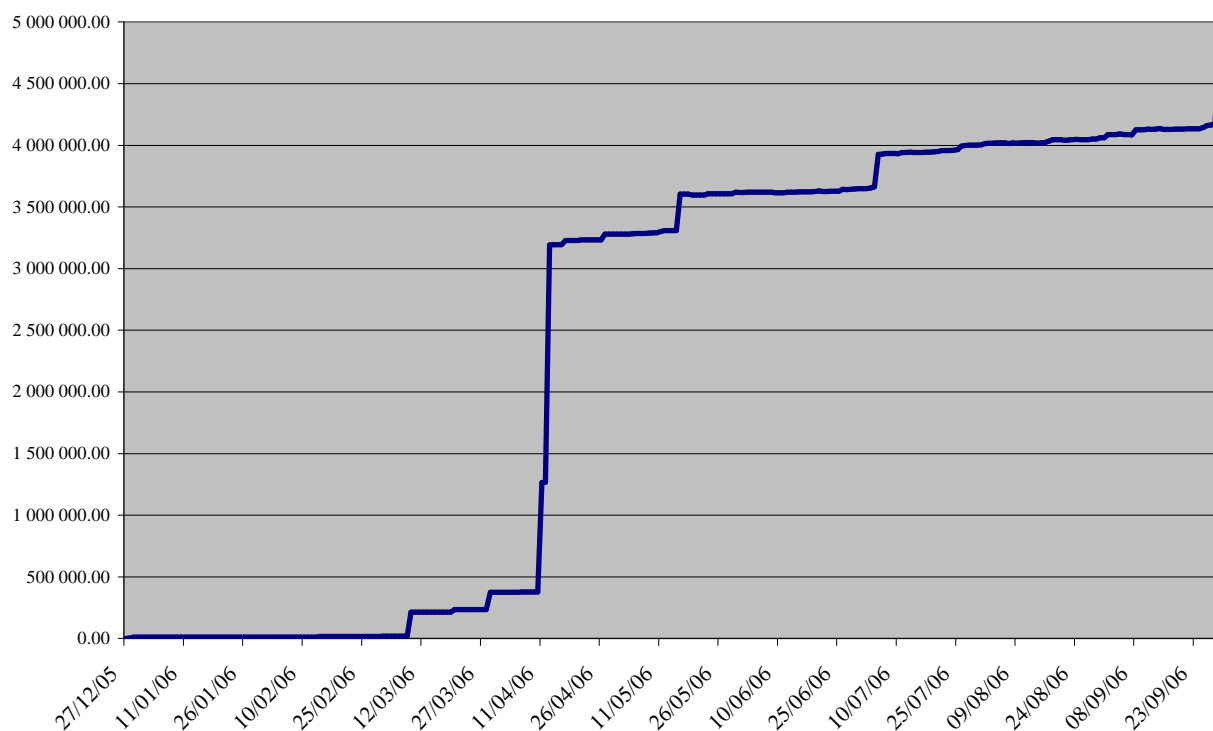
Към 29 септември 2006г. друг актив на Фонда представлява вземане, свързано със записване на акции от увеличение на капитала на дружество, търгувано на БФБ – София, продажба на права и авансово платена такса на КФН.

3) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 3: Нетна стойност на активите на Фонда в началото и в края на отчетния период

На 31.08.2006 г. е изчислена нетна стойност на активите в размер на 4 062 322 лв. Към 29.09.2006 г. нетната стойност на активите е 4 756 161 лв.

Изменението на нетната стойност на активите на Фонда е представено на следващата графика.

Нетна стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт



4) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 3: Средна месечна и средна годишна нетна стойност на активите на Фонда

Средната месечна нетна стойност на активите на Фонда е 4 165 877 лева. Средната годишна нетна стойност на активите е 2 411 119 лева.

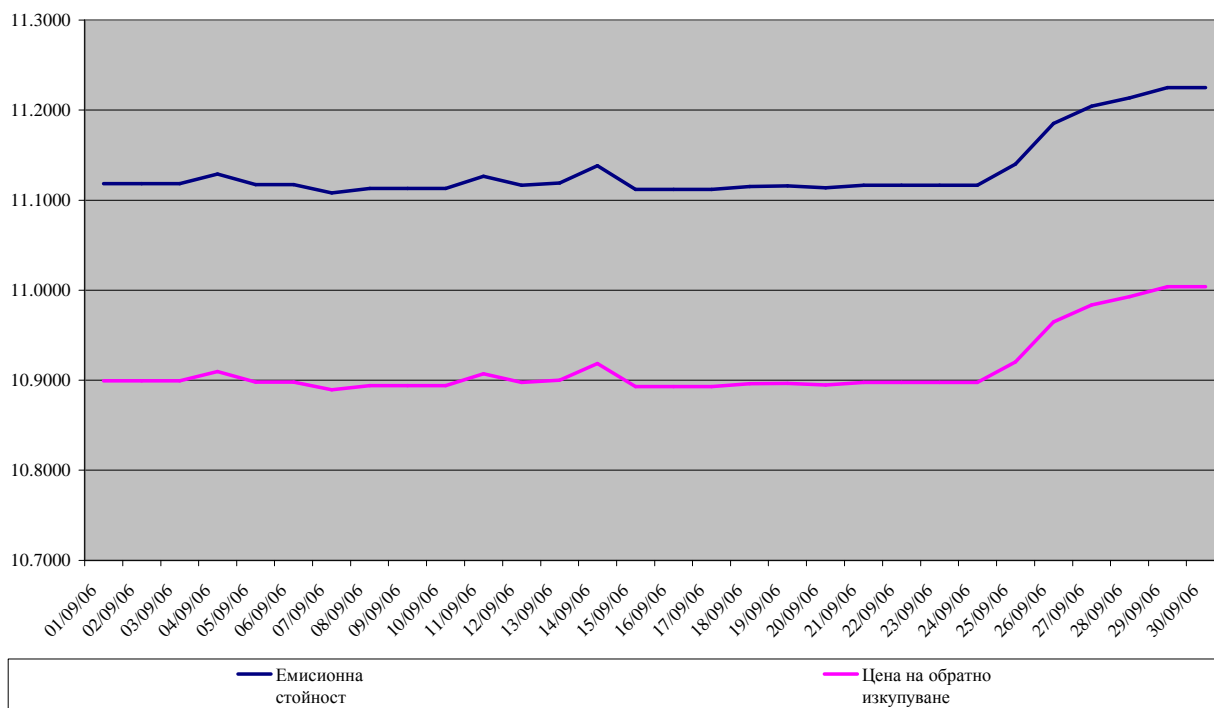
5) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 4: Данни за обявените емисионна стойност и цена на обратно изкупуване и датите на тяхното обявяване

Динамиката на емисионната стойност и цената на обратно изкупуване на дяловете на ДФ „Ти Би Ай Комфорт” за периода 01.09.2006–29.09.2006 е представена в таблицата и графиката по-долу:

Дата	Емисионна стойност	Цена на обратно изкупуване
02/10/06	11.2320	11.0107
29/09/06	11.2138	10.9929
28/09/06	11.2044	10.9836
27/09/06	11.1851	10.9647
26/09/06	11.1399	10.9244

25/09/06	11.1167	10.8976
21/09/06	11.1138	10.8949
20/09/06	11.1157	10.8966
19/09/06	11.1152	10.8961
18/09/06	11.1118	10.8929
15/09/06	11.1382	10.9187
14/09/06	11.1190	10.8999
13/09/06	11.1167	10.8976
12/09/06	11.1264	10.9072
11/09/06	11.1129	10.8940
08/09/06	11.1080	10.8891
07/09/06	11.1172	10.8981
05/09/06	11.1288	10.9095
04/09/06	11.1183	10.8992
01/09/06	11.1029	10.8841

Динамиката на емисионната стойност и цената на обратно изкупуване на дяловете на ДФ „Ти Би Ай Комфорт“



б) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 5: Брой и цени на издадените (продадените) дялове

За периода са записани 58 819.5792 дяла.

Таблицата по-долу представя продажбата на дялове на ДФ Ти Би Ай Комфорт за месец септември.

Дата	Вид операция	Брой дялове	Цена	Сума в лева
01/09/2006	записване	1 756.2979	11.1029	19 500.00
08/09/2006	записване	3 701.2964	11.1080	41 114.00
11/09/2006	записване	179.9710	11.1129	2 000.00
13/09/2006	записване	100.0298	11.1167	1 112.00
19/09/2006	записване	107.9603	11.1152	1 200.00
20/09/2006	записване	179.9257	11.1157	2 000.00
26/09/2006	записване	71.8139	11.1399	800.00
27/09/2006	записване	10.4470	11.1850	116.85
29/09/2006	записване	52 711.8372	11.2138	591 100.00
ОБЩО:		58 819.5792		658 942.85

7) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 6: Брой и цени на изкупените обратно дялове

Обратното изкупуване на дялове започва след достигане на минималния размер на нетната стойност на активите на Фонда в размер на 500 000 лева.

През месец септември има обратно изкупени 119.7078 дяла от Фонда.

Дата	Вид операция	Брой дялове	Цена	Сума в лева
14/09/2006	обратно изкупуване	9.0000	10.9000	98.10
28/09/2006	обратно изкупуване	110.7078	10.9836	1 215.97
ОБЩО:		119.7078		1 314.07

В резултат на посочените по-горе записвания и обратни изкупувания, към 29.09.2006г. общият брой на дяловете на Фонда възлиза на 430 068.1844 дяла.

8) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 7: Сключени сделки с активи от портфейла на Фонда.

Следващата таблица представя в обобщен вид хронологията на сделките с активи на ДФ Ти Би Ай Комфорт за отчетния период.

Дата	Вид сделка	Инструмент	Брой изгъргвани ЦК	Сума в лева
04/09/2006	покупки	Корпоративни облигации	50	98 603
11/09/2006	покупки	Корпоративни облигации	913	150 552
20/09/2006	покупки	Корпоративни облигации	500	52 515
26/09/2006	продажби	Химическа промишленост	60	5 790
27/09/2006	продажби	Химическа промишленост	25	2 413
28/09/2006	продажби	Химическа промишленост	20	1 935
29/09/2006	покупки	Холдинги	1000	13 700
29/09/2006	продажби	Телекомуникации, Химическа промишленост	2748	28 797
ОБЩО:			5 316	354 304

III. Данни по чл. 18, ал. 3

Обобщена информация за отчетния период е представена в сравнителна таблица (виж *Приложение I*).

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД