
**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 31.08.2006г. корпоративните и общинските облигации представляват 15.10% 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 5.87 % от стойността на портфейла на Фонда.

Към 31.08.2006г. договорният фонд притежава акции, които представляват 18.18% от общите активи на фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 39.26% от портфейла, като 13.79% от тези средства са предоставени на краткосрочни депозити във връзка с ограниченията за ликвидност на Фонда.

Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 1.13 % от активите на Фонда към 31.08.2006г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.08.2006г. е 14.18% 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 4 013 639 лева към 31.07.2006г до 4 087 172.40 лева към 31.08.2006г.

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:

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

Разходи	Стойност в лева		
	30/06/2006	31/07/2006	31/08/2006
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	79,481	109,246	194,367
Отрицателни курсови разлики	179	186	186
Разходи за външни услуги	9,410	13,485	17,940
Други финансови разходи	1,519	1,660	1,758
Общо разходи:	90,589	124,577	214,251

Общият размер на разходите на фонда към 31.08.2006г. е 214 251 лева, които включват 194 367 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и отрицателни валутни курсови разлики в размер на 186 лева. Последните не са част от “всички разходи, свързани с дейността на дружеството” по чл. 171 ЗППЦК.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 31 август 2006 – 16 555 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.75%

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

- към 31 август 2006 – 179 лв.

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

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 31 август 2006 – 800 лв.

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

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

- към 31 август 2006 – 210 лв.

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

д) Други разходи

- към 31 август 2006г. – 1954 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.09%

- Други разходи по финансови операции: 1 579 лв.

- Външни услуги (КФН): 375 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 19 698 лв. към месец август. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 0.90%.

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

Долната таблица представя приходите на Фонда към 31.08.2006г. Приходите са в размер на 327 687 лева, включващи преоценка от операции с финансови активи и приходи от лихви и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лева		
	30/06/2006	31/07/2006	31/08/2006
Приходи от лихви	34,706	50,479	66,307
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	76,878	155,461	257,394
Други финансови приходи	422	2,593	3,986
Общо приходи:	112,006	208,533	327,687

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

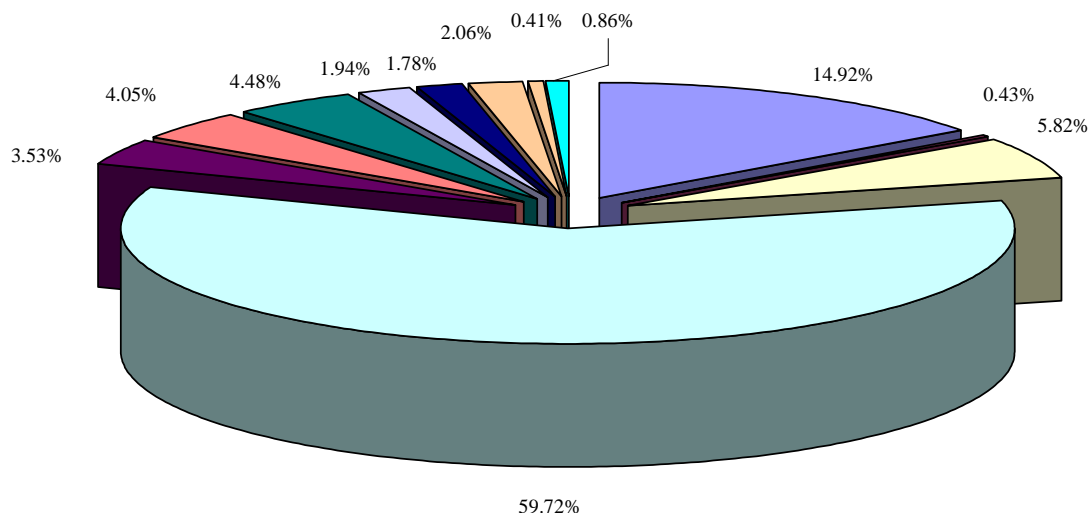
Структурата и обема на инвестициите в портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт в началото на периода са представени в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31/07/2006		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Корпоративни облигации	598 718	14.92%
BG2100014054	20 432	0.51%
BG2100002034	4 267	0.11%
BG2100007058	13 712	0.34%
BG2100018055	39 380	0.98%
BG2100017040	21 192	0.53%
BG2100036057	138 539	3.45%
BG2100032056	291 705	7.27%
BG2100016042	10 119	0.25%
BG2100017065	59 372	1.48%
Общински облигации	17 432	0.43%
BG2100005029	1 019	0.03%
BG2100007041	16 414	0.41%
Чуждестранни инвестиции	233 510	5.82%
DE000SG2J8T5	154 260	3.84%
XS0252187959	79 250	1.97%
Банкови депозити	2 396 995	59.72%
Акции - Холдинги	141 779	3.53%
BG1100046983	75 021	1.87%
BG1100019980	66 757	1.66%
Акции - Химическа промишленост	162 576	4.05%

BG11ORRUAT13	162 576	4.05%
Акции - Недвижими имоти	179 957	4.48%
BG1100025052	6 288	0.16%
BG1100019055	18 454	0.46%
BG1100030052	696	0.02%
BG1100042057	77 324	1.93%
BG1100109039	77 195	1.92%
Акции - Фармацевтична промишленост	77 877	1.94%
BG11BAKABT17	13 527	0.34%
BG11SOSOBT18	64 350	1.60%
Акции - Туризм	71 422	1.78%
BG11ALBAAT17	71 422	1.78%
Акции - Тютюнева промишленост	31 880	0.79%
BG11BLBLAT13	14 374	0.36%
BG11SOSOVT14	17 506	0.44%
Акции - Телекомуникации	35 039	0.87%
BG1100005997	35 039	0.87%
Акции - Финанси	15 600	0.39%
BG1100098059	15 600	0.39%
В брой и разплащателни сметки	16 419	0.41%
Вземания*	34 435	0.86%
Обща сума	4 013 639	100.00%

* Вземания във връзка със записването на права от увеличението на капитала на дружество, търгувано на БФБ-София АД, продажба на права, начислени дивиденди и авансово платена такса за поддържане на емисия на БФБ – София АД.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 31/07/2006



- Корпоративни облигации
- Общински облигации
- Чуждестранни инвестиции
- Банкови депозити
- Акции - Холдинги
- Акции - Химическа промишленост
- Акции - Нематериални имоти
- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Туризм
- Акции - Други
- В брой и разплащателни сметки
- Вземания*

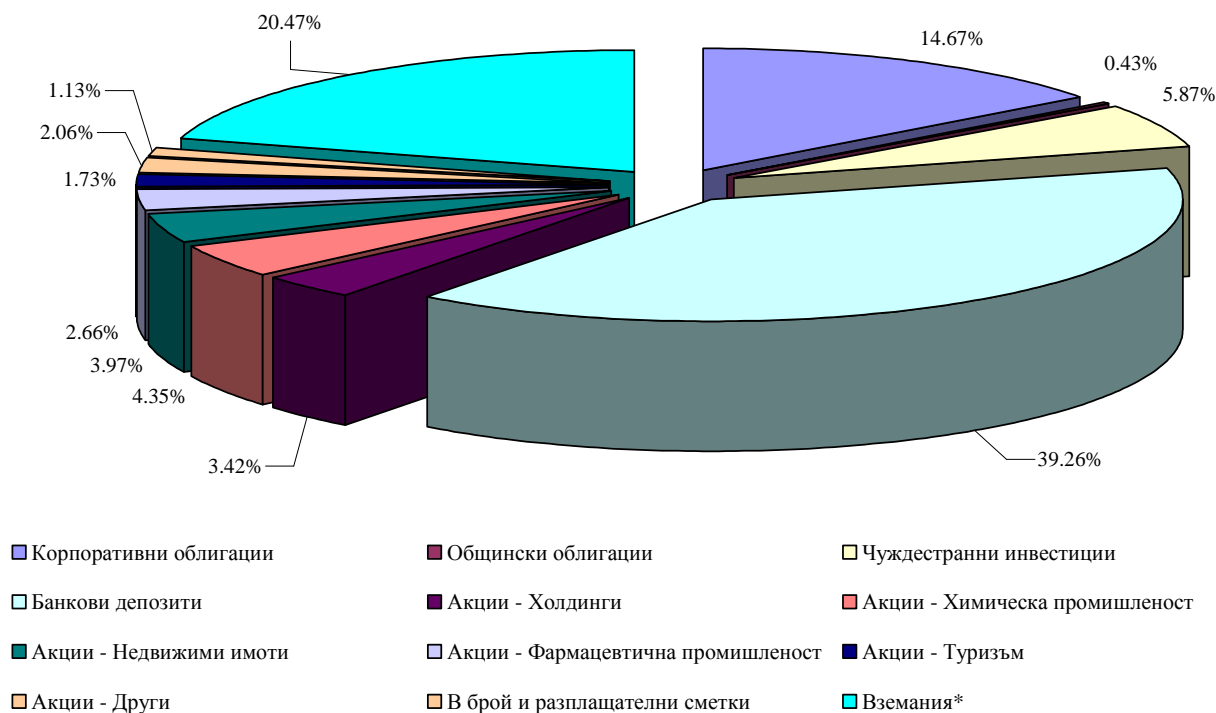
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт в края на периода е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 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



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

Към 31 юли 2006г. друг актив на Фонда представлява вземане, свързано със записване на акции от увеличение на капитала на дружество, търгувано на БФБ - София .

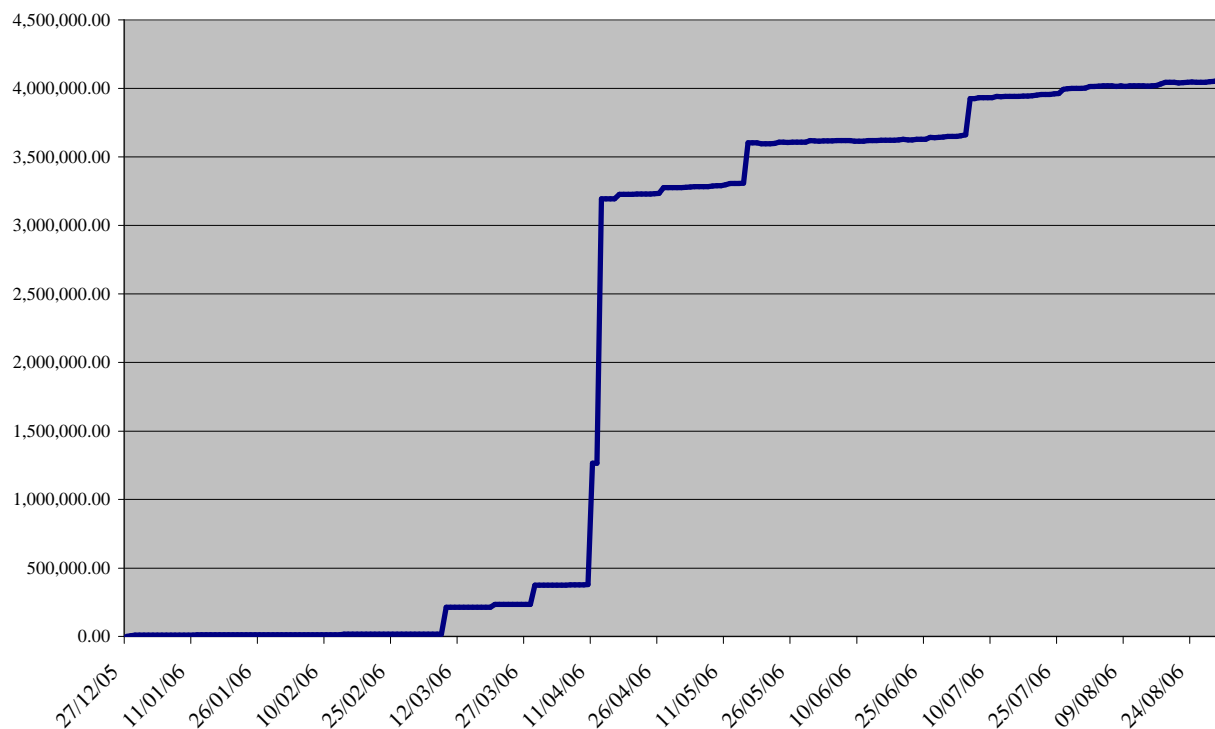
Към 31 август 2006г. друг актив на Фонда представлява вземане във връзка с начислени дивиденди и падеж на депозит, от който паричните средства постъпват на следващия ден - 01/09/2006.

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

На 31.07.2006 г. е изчислена нетна стойност на активите в размер на 4 003 167 лв. Към 31.08.2006 г. нетната стойност на активите е 4 062 322 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 4 032 200 лева. Средната годишна нетна стойност на активите е 2 194 482 лева.

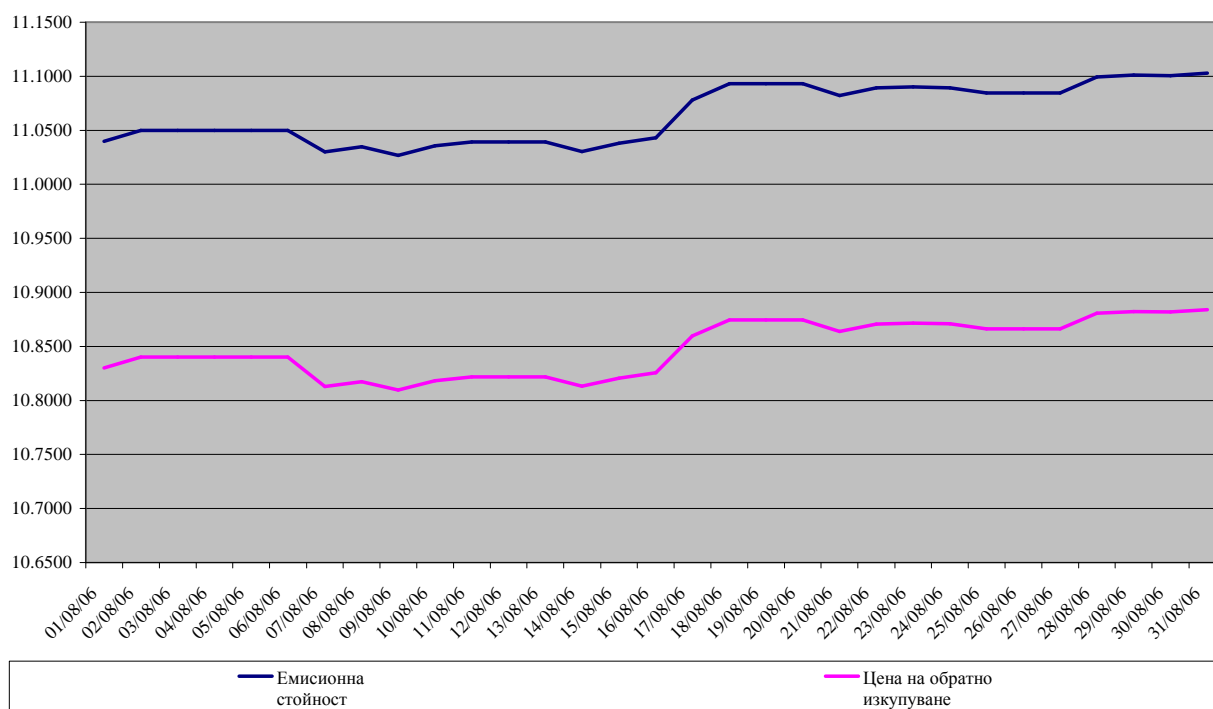
5) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 4: Данни за обявените емисионна стойност и цена на обратно изкупуване и датите на тяхното обявяване

Динамиката на емисионната стойност и цената на обратно изкупуване на дяловете на ДФ „Ти Би Ай Комфорт” за периода 31.07.2006–31.08.2006 е представена в таблицата и графиката по-долу:

Дата	Емисионна стойност	Цена на обратно изкупуване
01/09/2006	11.1029	10.8841
31/08/2006	11.1006	10.8819
30/08/2006	11.1009	10.8821
29/08/2006	11.0993	10.8806
28/08/2006	11.0845	10.8661

25/08/2006	11.0892	10.8707
24/08/2006	11.0902	10.8717
23/08/2006	11.0891	10.8706
22/08/2006	11.0822	10.8638
21/08/2006	11.0931	10.8746
18/08/2006	11.0781	10.8598
17/08/2006	11.0432	10.8256
16/08/2006	11.0381	10.8206
15/08/2006	11.0304	10.8131
14/08/2006	11.0390	10.8215
11/08/2006	11.0356	10.8181
10/08/2006	11.0268	10.8095
09/08/2006	11.0347	10.8172
08/08/2006	11.0301	10.8128
07/08/2006	11.0500	10.8400
04/08/2006	11.0500	10.8400
03/08/2006	11.0500	10.8400
02/08/2006	11.0400	10.8300
01/08/2006	11.0200	10.8100

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



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

За периода са записани 2 779.7308 дяла.

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

Дата	Вид операция	Брой дялове	Цена	Сума в лева
01/08/2006	записване	156.0799	11.0200	1 720.00
04/08/2006	записване	361.9910	11.0500	4 000.00
07/08/2006	записване	180.9955	11.0500	2 000.00
08/08/2006	записване	299.1813	11.0301	3 300.00
18/08/2006	записване	459.9868	11.0781	5 095.78
23/08/2006	записване	270.5359	11.0891	3 000.00
24/08/2006	записване	150.1325	11.0902	1 665.00
30/08/2006	записване	900.8279	11.1009	10 000.00
ОБЩО:		2 779.7308		30 780.78

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 август има обратно изкупени 60 дяла от Фонда.

Дата	Вид операция	Брой дялове	Цена	Сума в лева
15/08/2006	обратно изкупуване	60	10.8132	648.79
ОБЩО:		60	10.8132	648.79

В резултат на посочените по-горе записвания и обратни изкупувания, към 31.08.2006г. общият брой на дяловете на Фонда възлиза на 371 368.3130 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 изтъргвани ЦК	Сума в лева
01/08/2006	покупки	Акции - Туризм	43	3 440
01/08/2006	продажби	Акции - Недвижими имоти, Фармацевтична промишленост, Химическа промишленост	1,268	15 422
02/08/2006	продажби	Акции - Недвижими имоти	126	208
17/08/2006	покупки	Корпоративни облигации	5	10 128
30/08/2006	покупки	Корпоративни облигации	357	619 795
30/08/2006	продажби	Акции и права - Недвижими имоти	20,000	8 700
ОБЩО:			21 799	657 693

III. Данни по чл. 18, ал. 3

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

Стоян Гошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД