
**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

***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 30.11.2006г. корпоративните и общинските облигации представляват 45.58% 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 5.03 % от стойността на портфейла на Фонда.

Към 30.11.2006г. договорният фонд притежава акции, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 15.92% от общите активи на фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 29.71% 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 1.22 % от активите на Фонда към 30.11.2006г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.11.2006г. е 14.53% на годишна база*.

***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 5 096 695 лева към 31.10.2006. до 5 295 795 лева към 30.11.2006г.

***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		
	30/09/2006	31/10/2006	30/11/2006
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	254 166	331 011	471 019
Отрицателни курсови разлики	329	336	353
Разходи за външни услуги	22 211	27 697	33 146
Други финансови разходи	2 264	2 637	3 428
Общо разходи:	278 970	361 681	507 946

Общият размер на разходите на фонда към 30.11.2006г. е 507 946 лева, които включват 471 019 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и отрицателни валутни курсови разлики в размер на 353 лева. Последните не са част от “всички разходи, свързани с дейността на дружеството” по чл. 171 ЗППЦК.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 30 ноември 2006 – 30 723 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.06%

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

- към 30 ноември 2006 – 624 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.02%

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 30 ноември 2006 – 1400 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.05%

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

- към 30 ноември 2006 – 367 лв.

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

д) Други разходи

- към 30 ноември 2006 – 3 460 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.12%

- Други разходи по финансови операции: 2804 лв.

- Външни услуги (КФН): 656 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 36 574 лв. към месец ноември. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 1.27%.

Приходи от управление на дейността или портфейла през отчетния период

Долната таблица представя приходите на Фонда към 30.11.2006г. Приходите са в размер на 793 850 лева, включващи преценка от операции с финансови активи и приходи от лихви и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лева		
	29/09/2006	31/10/2006	30/11/2006
Приходи от лихви	82 669	105 217	128 373
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	351 704	471 449	661 490
Други финансови приходи	3 986	3 986	3 986
Общо приходи:	438 360	580 653	793 850

II. Данни по чл. 18, ал. 2

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

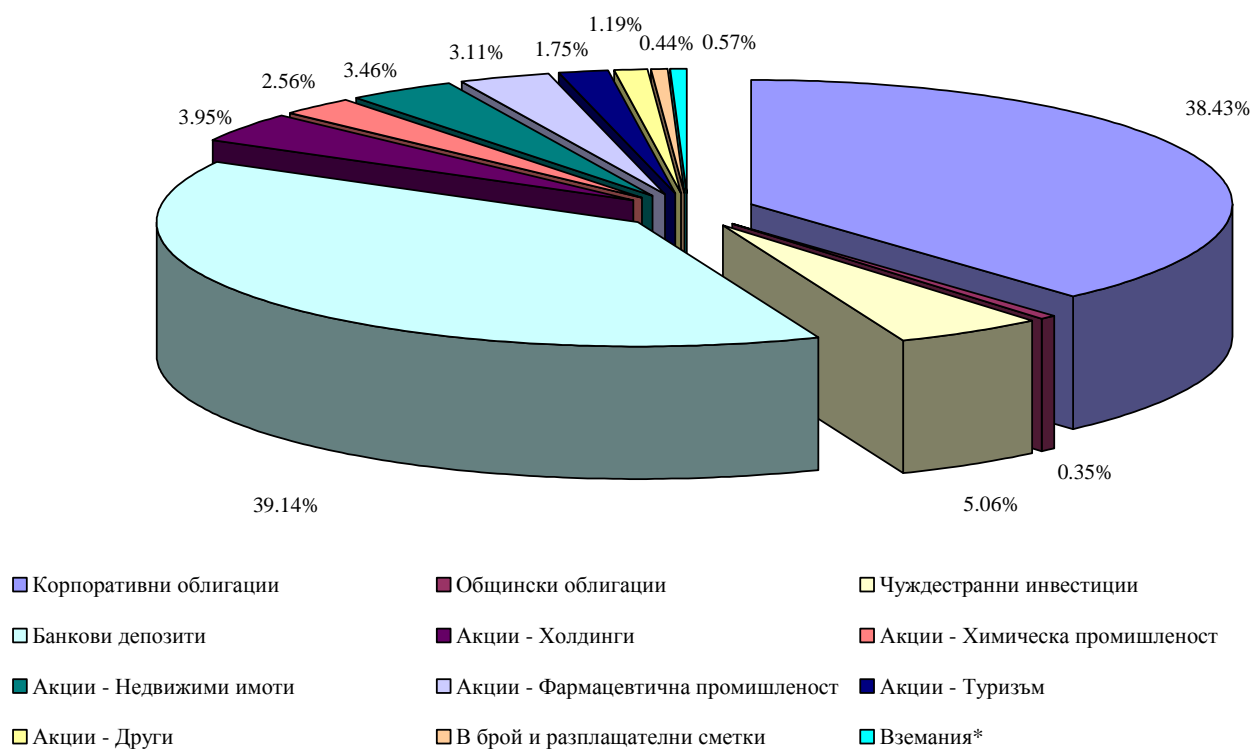
Структурата и обема на инвестициите в портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт в началото на периода са представени в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31/10/2006		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Корпоративни облигации	1 958 737	38.43%
BG2100014054	155 489	3.05%
BG2100002034	149 031	2.92%
BG2100007058	162 058	3.18%
BG2100018055	38 876	0.76%
BG2100017040	194 169	3.81%
BG2100036057	183 086	3.59%
BG2100032056	306 099	6.01%
BG2100014062	304 939	5.98%
BG2100017065	61 917	1.21%
BG2100027056	59 828	1.17%
BG2100031066	60 069	1.18%
BG2100030068	181 568	3.56%
BG2100024061	101 610	1.99%
Общински облигации	17 714	0.35%
BG2100005029	1 038	0.02%
BG2100007041	16 676	0.33%
Чуждестранни инвестиции	257 958	5.06%
DE000SG2J8T5	172 629	3.39%

XS0252187959	85 329	1.67%
Банкови депозити	1 994 798	39.14%
Акции - Холдинги	201 384	3.95%
BG1100046983	89 230	1.75%
BG1100005971	34 393	0.67%
BG1100019980	77 761	1.53%
Акции - Химическа промишленост	130 247	2.56%
BG11ORRUAT13	130 247	2.56%
Акции - Недвижими имоти	176 541	3.46%
BG1100025052	6 000	0.12%
BG1100019055	17 602	0.35%
BG1100030052	730	0.01%
BG1100042057	83 166	1.63%
BG1100109039	69 043	1.35%
Акции - Фармацевтична промишленост	158 628	3.11%
BG11BAKABT17	125 919	2.47%
BG11SOSOBT18	32 710	0.64%
Акции - Туризм	88 984	1.75%
BG11ALBAAT17	88 984	1.75%
Акции - Тютюнева промишленост	35 226	0.69%
BG11BLBLAT13	13 589	0.27%
BG11SOSOV14	21 637	0.42%
Акции - Телекомуникации	7 487	0.15%
BG1100005997	7 487	0.15%
Акции - Финанси	17 890	0.35%
BG1100098059	17 890	0.35%
В брой и разплащателни сметки	22 232	0.44%
Вземания*	28 870	0.57%
Обща сума	5 096 695	100.00%

* Вземания във връзка с участие в 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 31/10/2006



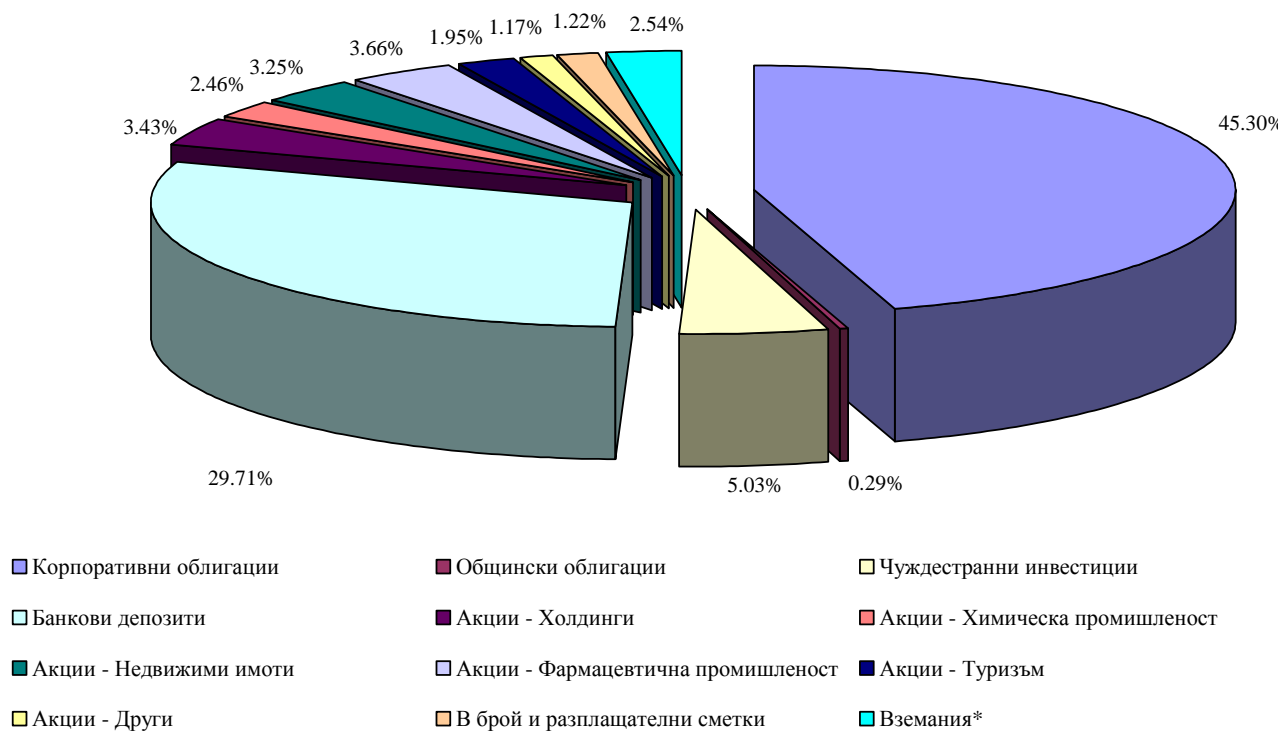
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт в края на периода е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 30/11/2006		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Корпоративни облигации	2 398 732	45.30%
BG2100014054	156 071	2.95%
BG2100002034	202 977	3.83%
BG2100007058	162 970	3.08%
BG2100018055	39 093	0.74%
BG2100017040	195 301	3.69%
BG2100036057	185 182	3.50%
BG2100032056	253 821	4.79%
BG2100014062	298 114	5.63%
BG2100017065	62 301	1.18%
BG2100027056	60 171	1.14%
BG2100031066	60 831	1.15%
BG2100030068	284 081	5.36%
BG2100001051	30 941	0.58%
BG2100037063	202 414	3.82%
BG2100024061	204 465	3.86%
Общински облигации	15 107	0.29%

	BG2100005029	1 044	0.02%
	BG2100007041	14 063	0.27%
Чуждестранни инвестиции		266 533	5.03%
	DE000SG2J8T5	176 259	3.33%
	XS0252187959	90 273	1.70%
Банкови депозити		1 573 166	29.71%
Акции - Холдинги		181 837	3.43%
	BG1100046983	95 400	1.80%
	BG1100005971	43 182	0.82%
	BG1100019980	43 256	0.82%
Акции - Химическа промишленост		130 102	2.46%
	BG11ORRUAT13	130 102	2.46%
Акции - Недвижими имоти		171 994	3.25%
	BG1100025052	6 000	0.11%
	BG1100019055	17 886	0.34%
	BG1100030052	720	0.01%
	BG1100042057	76 890	1.45%
	BG1100109039	70 499	1.33%
Акции - Фармацевтична промишленост		193 926	3.66%
	BG11BAKABT17	140 772	2.66%
	BG11SOSOBT18	53 153	1.00%
Акции - Туризм		103 438	1.95%
	BG11ALBAAT17	103 438	1.95%
Акции - Тютюнева промишленост		33 825	0.64%
	BG11BLBLAT13	13 031	0.25%
	BG11SOSOV14	20 794	0.39%
Акции - Телекомуникации		7 405	0.14%
	BG1100005997	7 405	0.14%
Акции - Финанси		20 731	0.39%
	BG1100098059	20 731	0.39%
В брой и разплащателни сметки		64 659	1.22%
Вземания*		134 341	2.54%
Обща сума		5 295 795	100.00%

* Вземания във връзка с участие в увеличението на капитала на две дружества, изплащане на част от главница по емисия общински облигации и авансово платена такса на КФН.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 30/11/2006



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

Към 31 октомври 2006г. друг актив на Фонда представлява вземане в размер на 28 870 лв., свързано участие в увеличението на капитала на дружество, търгувано на БФБ – София, продажба на права и авансово платена такса на КФН.

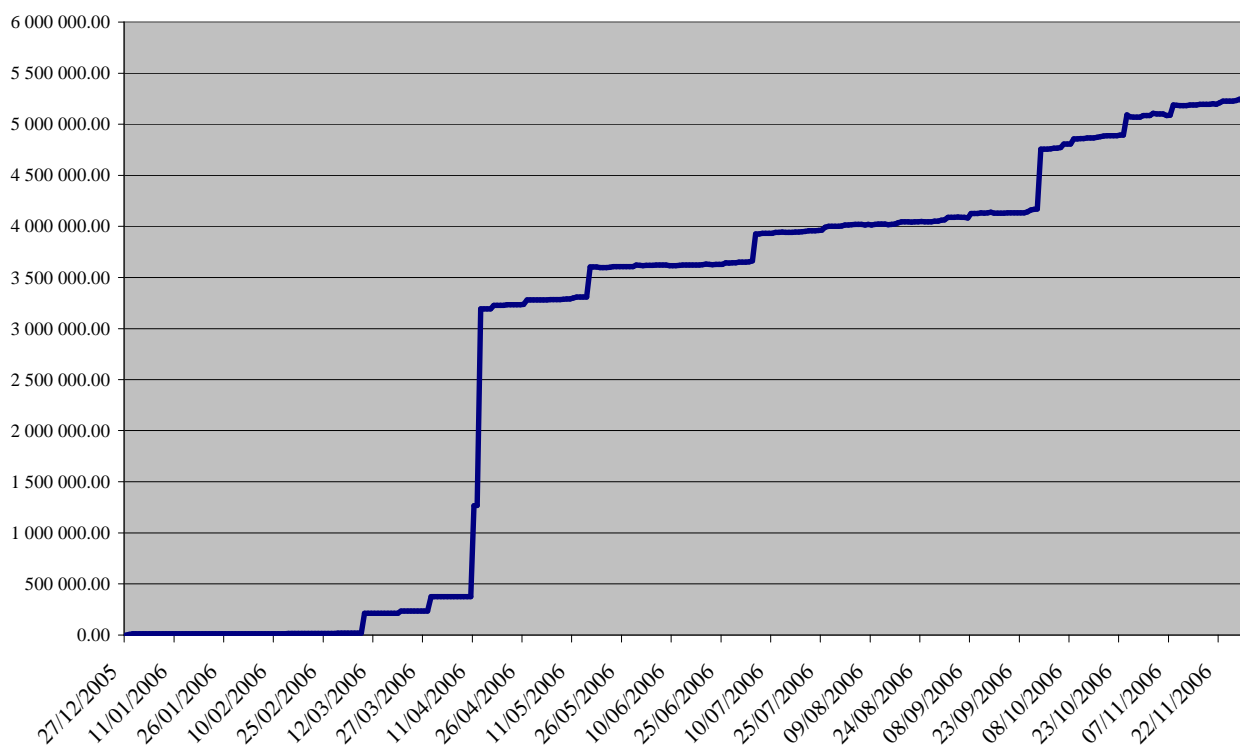
Към 30 ноември 2006г. друг актив на Фонда представлява вземания в размер на 131 556 лв., свързани участие в увеличението на капитала на две дружества, вземане в размер на 2 689 лева за погасяване на главница по емисия общински облигации и авансово платена такса на КФН в размер на 94 лева .

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

На 31.10.2006 г. е изчислена нетна стойност на активите в размер на 5 086 604 лв. Към 30.11.2006 г. нетната стойност на активите нараства до 5 242 790 лв.

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

Нетна стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Комфорт



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 5 179 329 лева. Средната годишна нетна стойност на активите е 2 890 400 лева.

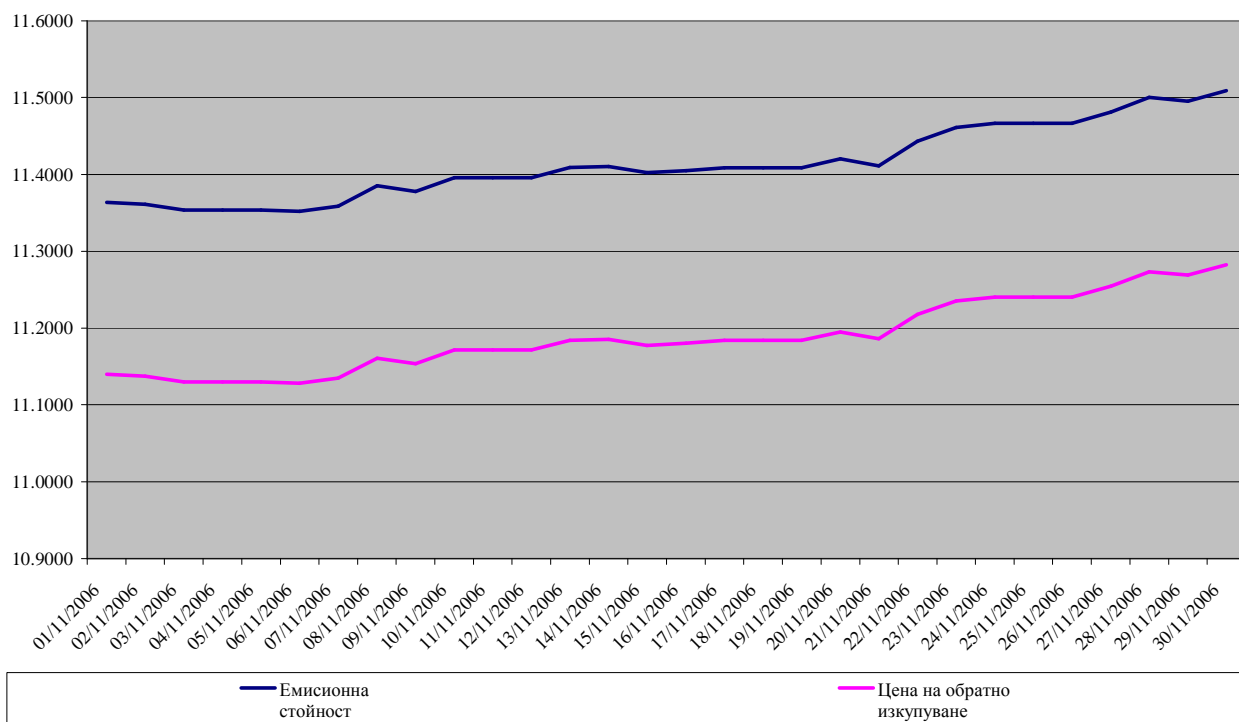
Данни по чл. 18, ал. 2 т. 4: Данни за обявените емисионна стойност и цена на обратно изкупуване и датите на тяхното обявяване

Динамиката на емисионната стойност и цената на обратно изкупуване на дяловете на ДФ „Ти Би Ай Комфорт” за периода 01.11.2006–30.11.2006 е представена в таблицата и графиката по-долу:

Дата	Емисионна стойност	Цена на обратно изкупуване
01/12/2006	11.5091	11.2823

30/11/2006	11.4955	11.2690
29/11/2006	11.5000	11.2734
28/11/2006	11.4809	11.2546
27/11/2006	11.4666	11.2406
24/11/2006	11.4610	11.2351
23/11/2006	11.4433	11.2178
22/11/2006	11.4112	11.1864
21/11/2006	11.4201	11.1950
20/11/2006	11.4086	11.1838
17/11/2006	11.4050	11.1803
16/11/2006	11.4022	11.1775
15/11/2006	11.4103	11.1855
14/11/2006	11.4089	11.1841
13/11/2006	11.3957	11.1712
10/11/2006	11.3777	11.1536
09/11/2006	11.3853	11.1609
08/11/2006	11.3587	11.1348
07/11/2006	11.3520	11.1283
06/11/2006	11.3535	11.1298
03/11/2006	11.3613	11.1374
02/11/2006	11.3635	11.1396
01/11/2006	11.3621	11.1382

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



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

За периода са записани 13 337.9130 дяла.

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

Дата	Вид операция	Брой дялове	Цена	Сума в лева
02/11/2006	записване	1 760.0212	11.3635	20 000.00
06/11/2006	записване	836.3060	11.3535	9 495.00
08/11/2006	записване	7 923.4419	11.3587	90 000.00
10/11/2006	записване	123.0477	11.3777	1 400.00
13/11/2006	записване	26.3257	11.3957	300.00
15/11/2006	записване	429.4366	11.4103	4 900.00
16/11/2006	записване	185.4905	11.4022	2 115.00
21/11/2006	записване	17.5130	11.4201	200.00
22/11/2006	записване	162.1214	11.4112	1 850.00
23/11/2006	записване	436.9369	11.4433	5 000.00
28/11/2006	записване	148.0720	11.4809	1 700.00

30/11/2006	записване	1 289.2001	11.4955	14 820.00
ОБЩО:		13 337.9130		151 780.00

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 октомври има обратно изкупени 5 363.5222 дяла от Фонда.

Дата	Вид операция	Брой дялове	Цена	Сума в лева
01/11/2006	обратно изкупуване	98.5222	11.1382	1 097.36
06/11/2006	обратно изкупуване	2 300.0000	11.1298	25 598.54
10/11/2006	обратно изкупуване	1 165.0000	11.1536	12 993.94
29/11/2006	обратно изкупуване	1 800.0000	11.2734	20 292.12
ОБЩО:		5 363.5222		59 981.96

В резултат на посочените по-горе записвания и обратни изкупувания, към 30.11.2006г. общият брой на дяловете на Фонда възлиза на 462 369.1727 дяла.

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
01/11/2006	продажби	Холдинги	1 000	4 730
02/11/2006	покупки	Туризм, Фармацевтична промишленост	1 062	13 431
03/11/2006	покупки	Туризм, Фармацевтична промишленост, Холдинги	1 540	13 979
08/11/2006	покупки	Корпоративни облигации	515	83 794
09/11/2006	покупки	Корпоративни облигации, акции Туризм, Фармацевтична промишленост	110	99 853
10/11/2006	покупки	Холдинги	200	3 753
10/11/2006	продажби	Фармацевтична промишленост	1 000	6 180
13/11/2006	покупки	Холдинги	130	2 425
14/11/2006	продажби	Холдинги	10 000	53 000
17/11/2006	покупки	Химическа промишленост, Други	8 391	59 933

20/11/2006	покупки	Други	20 000	19 000
20/11/2006	продажби	Фармацевтична промишленост	1 447	9 695
21/11/2006	покупки	Фармацевтична промишленост	300	1 836
22/11/2006	покупки	Фармацевтична промишленост	200	1 226
23/11/2006	продажби	Корпоративни облигации	20	39 782
28/11/2006	покупки	Холдинги	310	4 309
29/11/2006	покупки	Химическа промишленост	27	2 911
ОБЩО:			46 252	419 834

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



Ул. Света София 7, ет. 6, София 1000
тел. 02 / 9350633
факс 02 / 9350617
