
**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 31.10.2006г. корпоративните и общинските облигации представляват 38.78% 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 5.06 % от стойността на портфейла на Фонда.

Към 31.10.2006г. договорният фонд притежава акции, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 16.02% от общите активи на фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 39.14% 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 0.44 % от активите на Фонда към 31.10.2006г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.10.2006г. е 14.30% 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 4 770 085 лева към 29.09.2006г. до 5 096 695 лева към 31.10.2006г.

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		
	31/08/2006	30/09/2006	31/10/2006
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	194 367	254 166	331 011
Отрицателни курсови разлики	186	329	336
Разходи за външни услуги	17 940	22 211	27 697
Други финансови разходи	1 758	2 264	2 637
Общо разходи:	214 251	278 970	361 681

Общият размер на разходите на фонда към 31.10.2006г. е 361 681 лева, които включват 331 011 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и отрицателни валутни курсови разлики в размер на 336 лева. Последните не са част от “всички разходи, свързани с дейността на дружеството” по чл. 171 ЗППЦК.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 31 октомври 2006 – 25 620 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.96%

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

- към 31 октомври 2006 – 419 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.016%

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 31 октомври 2006 – 1200 лв.

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

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

- към 31 октомври 2006 – 315 лв.

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

д) Други разходи

- към 31 октомври 2006 – 2 780 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.10%

- Други разходи по финансови операции: 2218 лв.

- Външни услуги (КФН): 562 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 30 334 лв. към месец октомври. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 1.14%.

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

Долната таблица представя приходите на Фонда към 31.10.2006г. Приходите са в размер на 580 653 лева, включващи преоценка от операции с финансови активи и приходи от лихви и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лева		
	31/08/2006	29/09/2006	31/10/2006
Приходи от лихви	66 307	82 669	105 217
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	257 394	351 704	471 449
Други финансови приходи	3 986	3 986	3 986
Общо приходи:	327 687	438 360	580 653

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

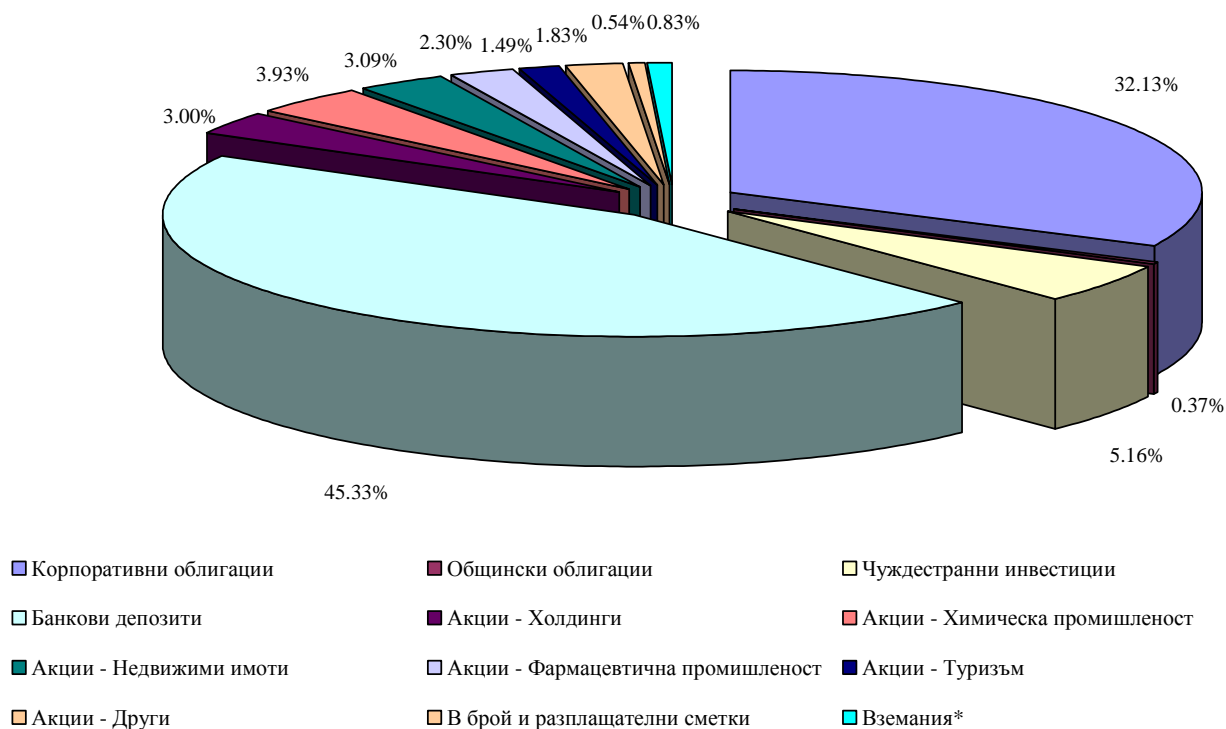
Структурата и обема на инвестициите в портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт в началото на периода са представени в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 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 - Туризм	70 940	1.49%
BG11ALBAAT17	70 940	1.49%
Акции - Тютюнева промишленост	34 413	0.72%
BG11BLBLAT13	12 633	0.26%
BG11SOSOVT14	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



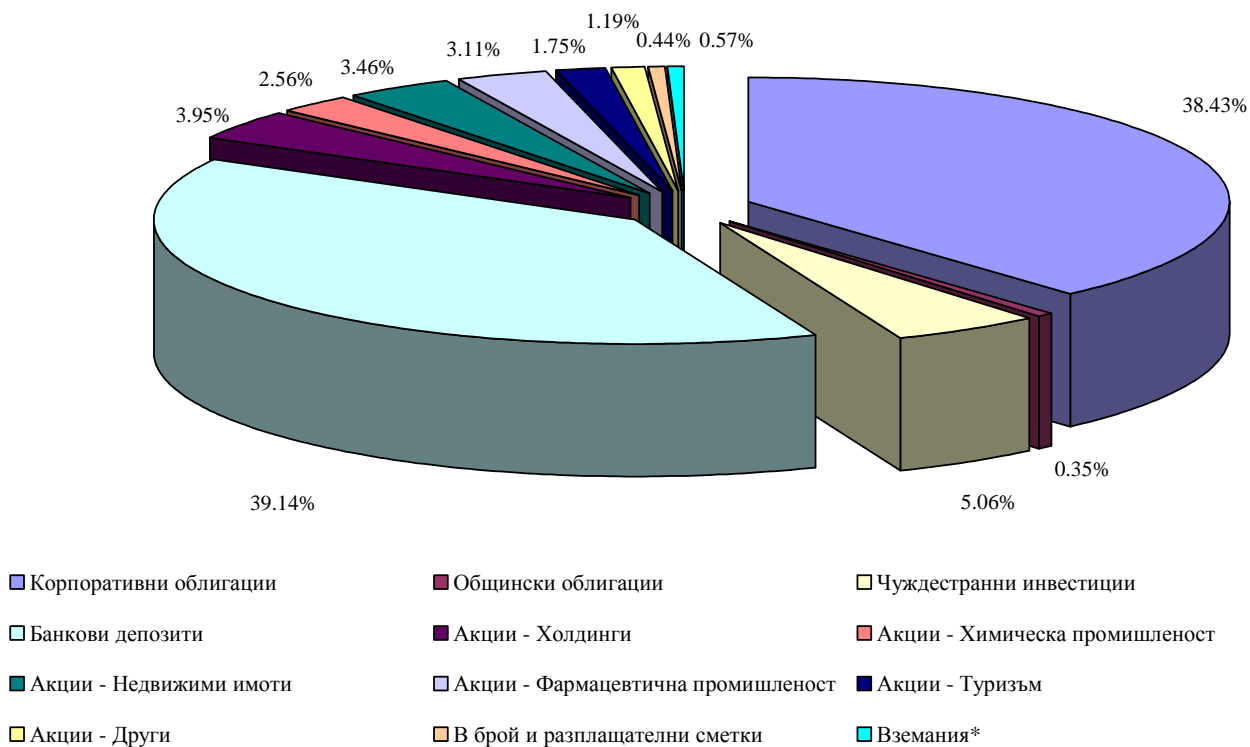
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт в края на периода е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31/10/2006		
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%
BG11SOSOVT14	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



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

Към 29 септември 2006г. друг актив на Фонда представлява вземане в размер на 39 540 лв., свързано със записване на акции от увеличение на капитала на дружество, търгувано на БФБ – София, продажба на права и авансово платена такса на КФН.

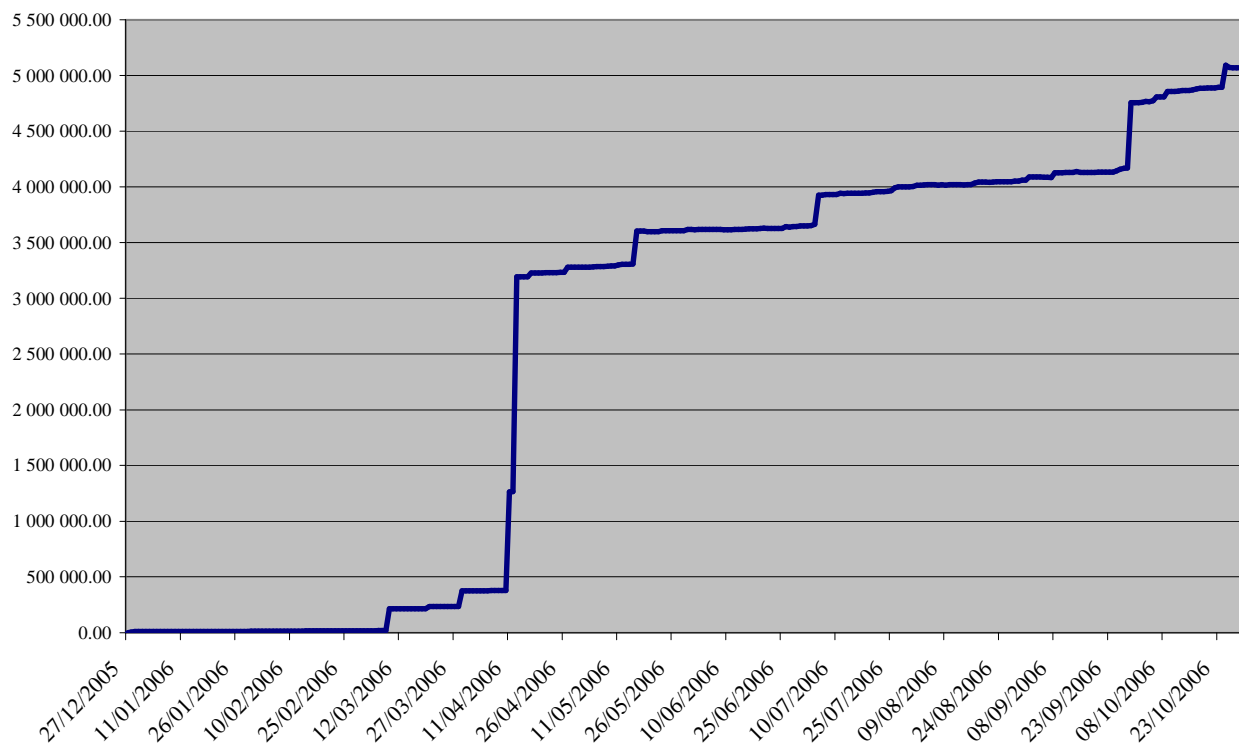
Към 31 октомври 2006г. друг актив на Фонда представлява вземане в размер на 28 870 лв., свързано участие в увеличението на капитала на дружество, търгувано на БФБ – София, продажба на права и авансово платена такса на КФН.

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

На 29.09.2006 г. е изчислена нетна стойност на активите в размер на 4 756 161 лв. Към 31.10.2006 г. нетната стойност на активите нараства до 5 086 604 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 4 896 072 лева. Средната годишна нетна стойност на активите е 2 664 519 лева.

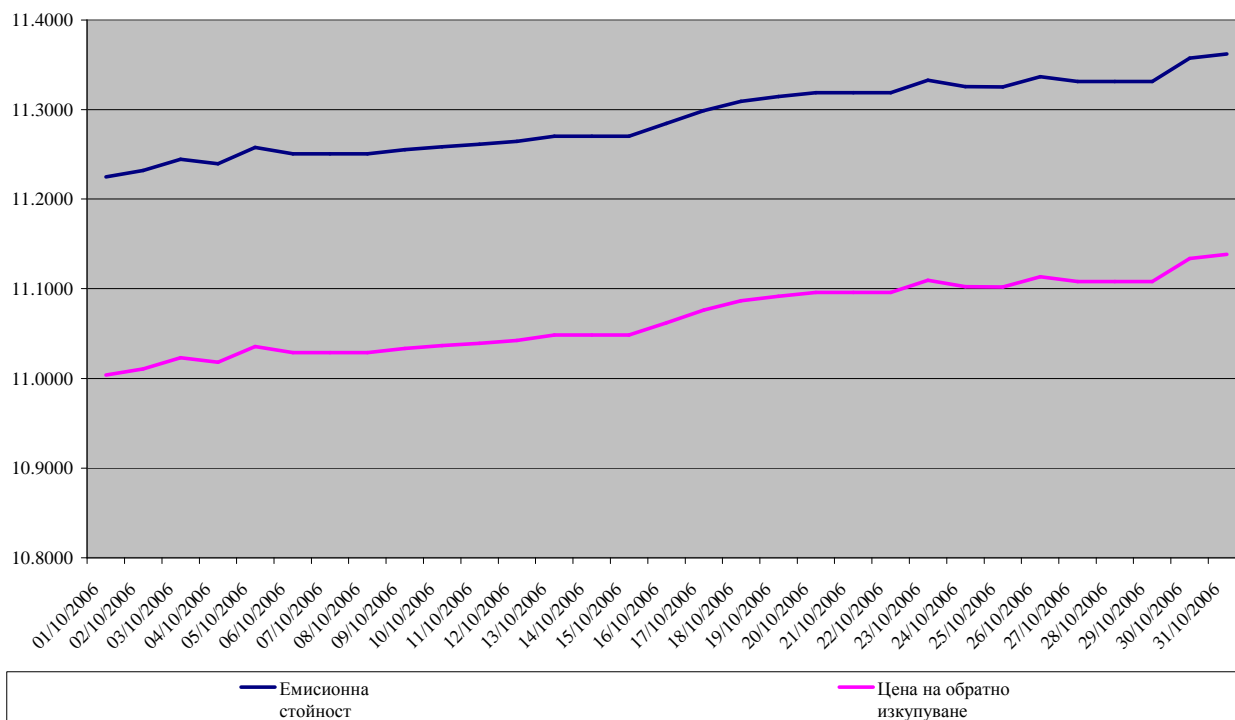
5) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 4: Данни за обявените емисионна стойност и цена на обратно изкупуване и датите на тяхното обявяване

Динамиката на емисионната стойност и цената на обратно изкупуване на дяловете на ДФ „Ти Би Ай Комфорт” за периода 01.10.2006–31.10.2006 е представена в таблицата и графиката по-долу:

Дата	Емисионна стойност	Цена на обратно изкупуване
01/11/2006	11.3621	11.1382
31/10/2006	11.3575	11.1338
30/10/2006	11.3314	11.1081
27/10/2006	11.3368	11.1135
26/10/2006	11.3254	11.1022

25/10/2006	11.3257	11.1025
24/10/2006	11.3327	11.1094
23/10/2006	11.3190	11.0959
20/10/2006	11.3147	11.0918
19/10/2006	11.3093	11.0865
18/10/2006	11.2989	11.0762
17/10/2006	11.2844	11.0620
16/10/2006	11.2704	11.0483
13/10/2006	11.2644	11.0424
12/10/2006	11.2613	11.0394
11/10/2006	11.2584	11.0365
10/10/2006	11.2550	11.0333
09/10/2006	11.2505	11.0288
06/10/2006	11.2575	11.0356
05/10/2006	11.2394	11.0179
04/10/2006	11.2446	11.0230
03/10/2006	11.2320	11.0107
02/10/2006	11.2320	11.0107

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 26 954.9675 дяла.

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

Дата	Вид операция	Брой дялове	Цена	Сума в лева
03/10/2006	записване	178.0627	11.2320	2 000.00
05/10/2006	записване	88.9727	11.2394	1 000.00
06/10/2006	записване	3 319.2538	11.2575	37 366.50
09/10/2006	записване	4 230.9231	11.2505	47 600.00
12/10/2006	записване	6.8456	11.2612	77.09
13/10/2006	записване	213.0610	11.2644	2 400.00
16/10/2006	записване	52.3495	11.2704	590.00
17/10/2006	записване	88.6179	11.2844	1 000.00
19/10/2006	записване	88.4228	11.3093	1 000.00
24/10/2006	записване	199.8641	11.3327	2 265.00
25/10/2006	записване	17 835.5421	11.3257	202 000.00
30/10/2006	записване	653.0525	11.3314	7 400.00
ОБЩО:		26 954.9678		304 698.59

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 октомври има обратно изкупени 2 628.3700 дяла от Фонда.

Дата	Вид операция	Брой дялове	Цена	Сума в лева
25/10/2006	обратно изкупуване	37.9310	11.1025	421.13
26/10/2006	обратно изкупуване	2 260.0000	11.1022	25 090.97
30/10/2006	обратно изкупуване	197.0443	11.1081	2 188.79
31/10/2006	обратно изкупуване	133.3947	11.1338	1 485.19
ОБЩО:		2 628.3700		29 186.08

В резултат на посочените по-горе записвания и обратни изкупувания, към 31.10.2006г. общият брой на дяловете на Фонда възлиза на 454 394.7822 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 изгървани ЦК	Сума в лева
02/10/2006	покупки	Фармацевтична промишленост	500	3 100
02/10/2006	продажби	Фармацевтична промишленост	1000	10 980
03/10/2006	покупки	Фармацевтична промишленост	1500	9 300
03/10/2006	продажби	Химическа промишленост	710	69 423
04/10/2006	покупки	Корпоративни облигации, Недвижими имоти	363	500 190
05/10/2006	покупки	Холдинги	297	5 052
06/10/2006	покупки	Холдинги, Фармацевтична промишленост	2100	30 354
06/10/2006	продажби	Фармацевтична промишленост	90	995
09/10/2006	покупки	Фармацевтична промишленост	3800	23 560
10/10/2006	покупки	Холдинги, Фармацевтична промишленост	3144	16 297
13/10/2006	покупки	Фармацевтична промишленост	1000	6 300
16/10/2006	покупки	Туризм	100	7 600
20/10/2006	покупки	Фармацевтична промишленост	1520	9 667
23/10/2006	покупки	Фармацевтична промишленост	720	4 588
24/10/2006	покупки	Туризм	10	759
25/10/2006	покупки	Фармацевтична промишленост, Недвижими имоти	905	5 689
26/10/2006	покупки	Туризм, Недвижими имоти	119	8 671
30/10/2006	покупки	Фармацевтична промишленост, Недвижими имоти, Корпоративни облигации	3835	123 360
30/10/2006	продажби	Фармацевтична промишленост	3780	23 814
31/10/2006	покупки	Фармацевтична промишленост	1233	7 727
ОБЩО:			26 726	867 425

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