
**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/продадени корпоративни и общински облигации и са закупени/продадени акции на публични дружества на БФБ – София АД.

Към 31.12.2006г. корпоративните и общинските облигации представляват 43.50% 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 5.22 % от стойността на портфейла на Фонда.

Към 31.12.2006г. договорният фонд притежава акции, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 17.10% от общите активи на фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 31.57% 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 1.13 % от активите на Фонда към 31.12.2006г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.12.2006г. е 14.72% 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 5 295 795 лева към 30.11.2006. до 5 326 653 лева към 31.12.2006г.

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		
	31/10/2006	30/11/2006	31/12/2006
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	331 011	471 019	526 028
Отрицателни курсови разлики	336	353	356
Разходи за външни услуги	27 697	33 146	38 493
Други финансови разходи	2 637	3 428	3 718
Общо разходи:	361 681	507 946	568 595

Общият размер на разходите на фонда към 31.12.2006г. е 568 595 лева, които включват 526 028 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и отрицателни валутни курсови разлики в размер на 356 лева.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 31 декември 2006 – 35 723 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.16%

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

- към 31 декември 2006 – 806 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.03%

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 31 декември 2006 – 1600 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 декември 2006 – 420 лв.

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

д) Други разходи

- към 31 декември 2006 – 3 662 лв.

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

- Други разходи по финансови операции: 2912 лв.

- Външни услуги (КФН): 750 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 42 211 лв. към месец декември. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 1.37%.

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

Долната таблица представя приходите на Фонда към 31.12.2006г. Приходите са в размер на 919 872 лева, включващи преценка от операции с финансови активи и приходи от лихви и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лева		
	31/10/2006	30/11/2006	31/12/2006
Приходи от лихви	105 217	128 373	150 951
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	471 449	661 490	764 934
Други финансови приходи	3 986	3 986	3 987
Общо приходи:	580 653	793 850	919 872

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

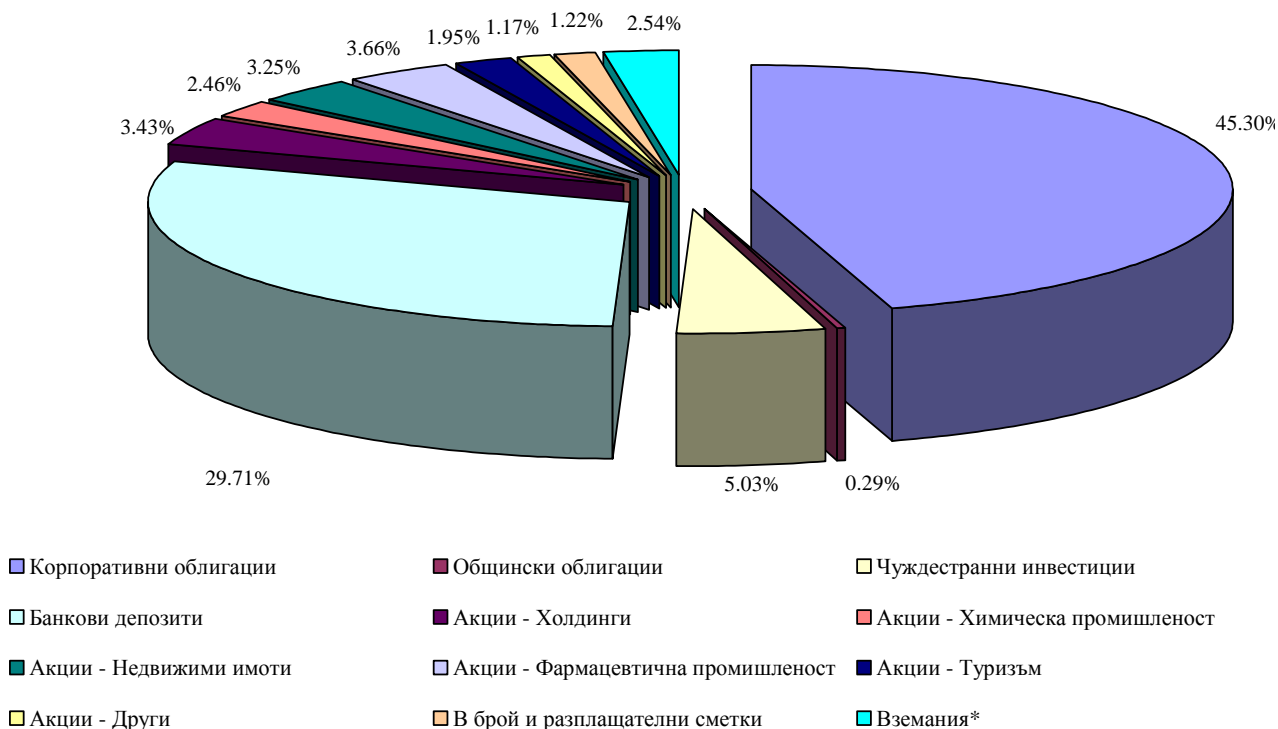
Структурата и обема на инвестициите в портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт в началото на периода са представени в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 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%
BG11SOSOVT14	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



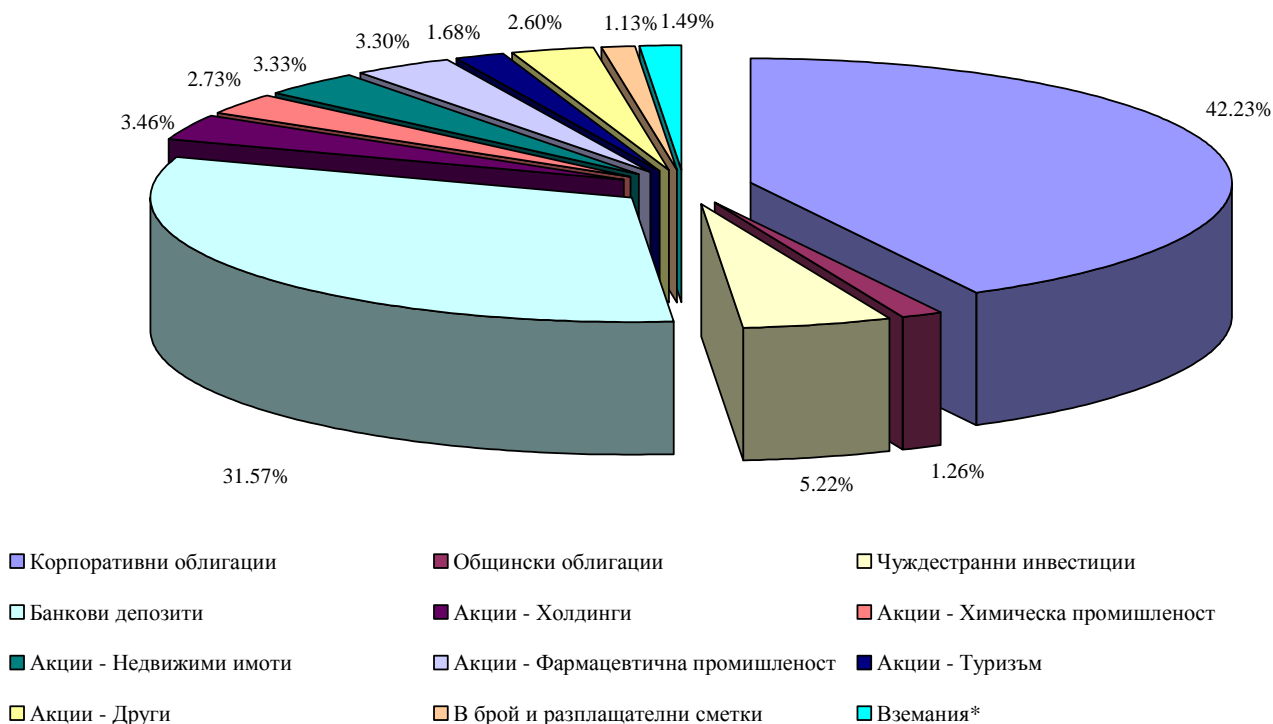
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт в края на периода е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31/12/2006		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Корпоративни облигации	2 249 593	42.23%
BG2100014054	156 916	2.95%
BG2100002034	203 973	3.83%
BG2100007058	163 879	3.08%
BG2100018055	39 302	0.74%
BG2100017040	196 378	3.69%
BG2100036057	181 167	3.40%
BG2100032056	255 004	4.79%
BG2100017065	60 258	1.13%
BG2100027056	60 517	1.14%
BG2100031066	160 841	3.02%
BG2100030068	387 699	7.28%
BG2100001051	31 111	0.58%
BG2100037063	40 329	0.76%
BG2100024061	312 220	5.86%
Общински облигации	67 275	1.26%
BG2100005029	13 589	0.26%
BG2100003057	53 687	1.01%
Чуждестранни инвестиции	278 205	5.22%

	DE000SG2J8T5	185 381	3.48%
	XS0252187959	92 824	1.74%
Банкови депозити		1 681 515	31.57%
Акции - Холдинги		184 175	3.46%
	BG1100046983	96 825	1.82%
	BG1100005971	44 518	0.84%
	BG1100019980	42 832	0.80%
Акции - Химическа промишленост		145 597	2.73%
	BG11ORRUAT13	145 597	2.73%
Акции - Недвижими имоти		177 197	3.33%
	BG1100025052	6 000	0.11%
	BG1100019055	18 312	0.34%
	BG1100030052	720	0.01%
	BG1100042057	72 492	1.36%
	BG1100109039	79 674	1.50%
Акции - Фармацевтична промишленост		175 893	3.30%
	BG11BAKABT17	121 860	2.29%
	BG11SOSOBT18	54 033	1.01%
Акции - Туризм		89 405	1.68%
	BG11ALBAAT17	89 405	1.68%
Акции - Тютюнева промишленост		34 112	0.64%
	BG11BLBLAT13	13 265	0.25%
	BG11SOSOV14	20 847	0.39%
Акции - Телекомуникации		7 502	0.14%
	BG1100005997	7 502	0.14%
Акции - Финанси		23 770	0.45%
	BG1100098059	23 770	0.45%
Акции - Електроника		58 258	1.09%
	BG1100075065	58 258	1.09%
Акции - Лека промишленост		14 856	0.28%
	BG11KAGAAT13	14 856	0.28%
В брой и разплащателни сметки		59 951	1.13%
Вземания*		79 348	1.49%
Обща сума		5 326 653	100.00%

* Вземания във връзка с участие в увеличението на капитала на две дружества, търгувани на БФБ - София АД.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 31/12/2006



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

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.

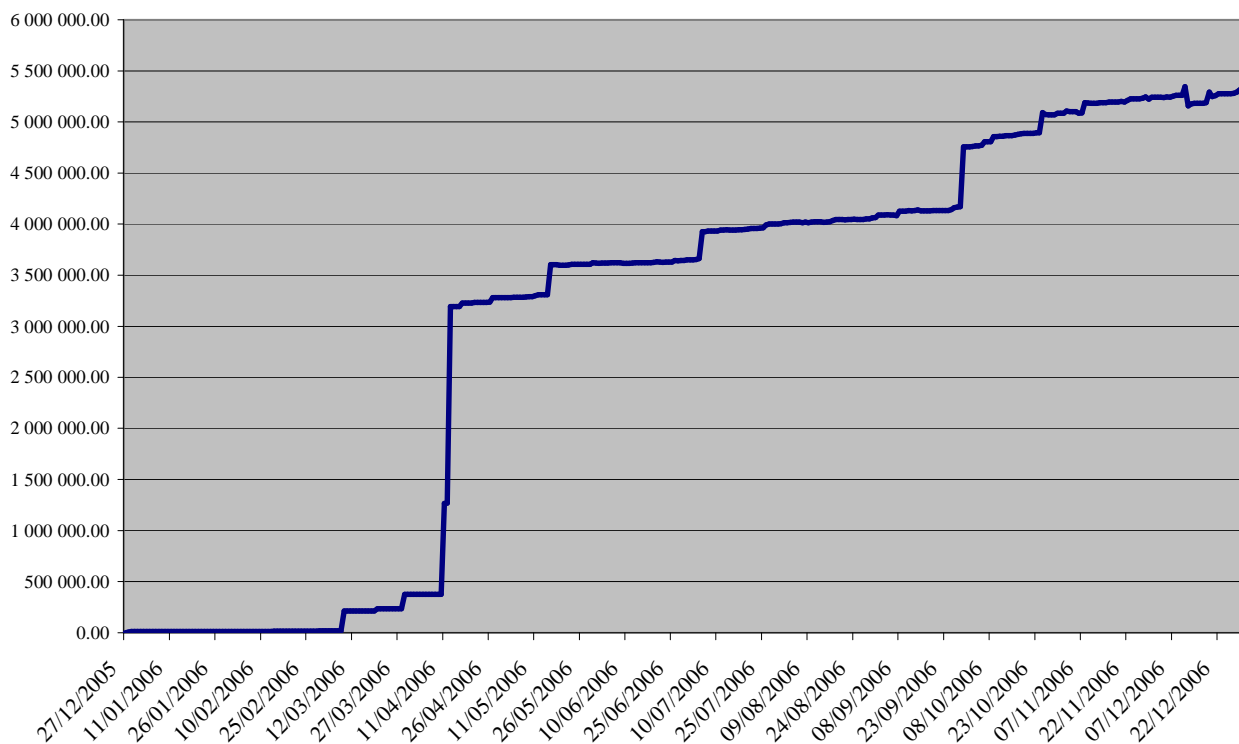
Към 31 декември 2006г. друг актив на Фонда представлява вземане в размер на 79 348 лв., свързани участие в увеличението на капитала на две дружества, търгувани на БФБ – София АД.

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

На 30.11.2006 г. е изчислена нетна стойност на активите в размер на 5 242 790 лв. Към 31.12.2006 г. нетната стойност на активите нараства до 5 312 563 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 5 250 925 лева. Средната годишна нетна стойност на активите е 3 090 883 лева.

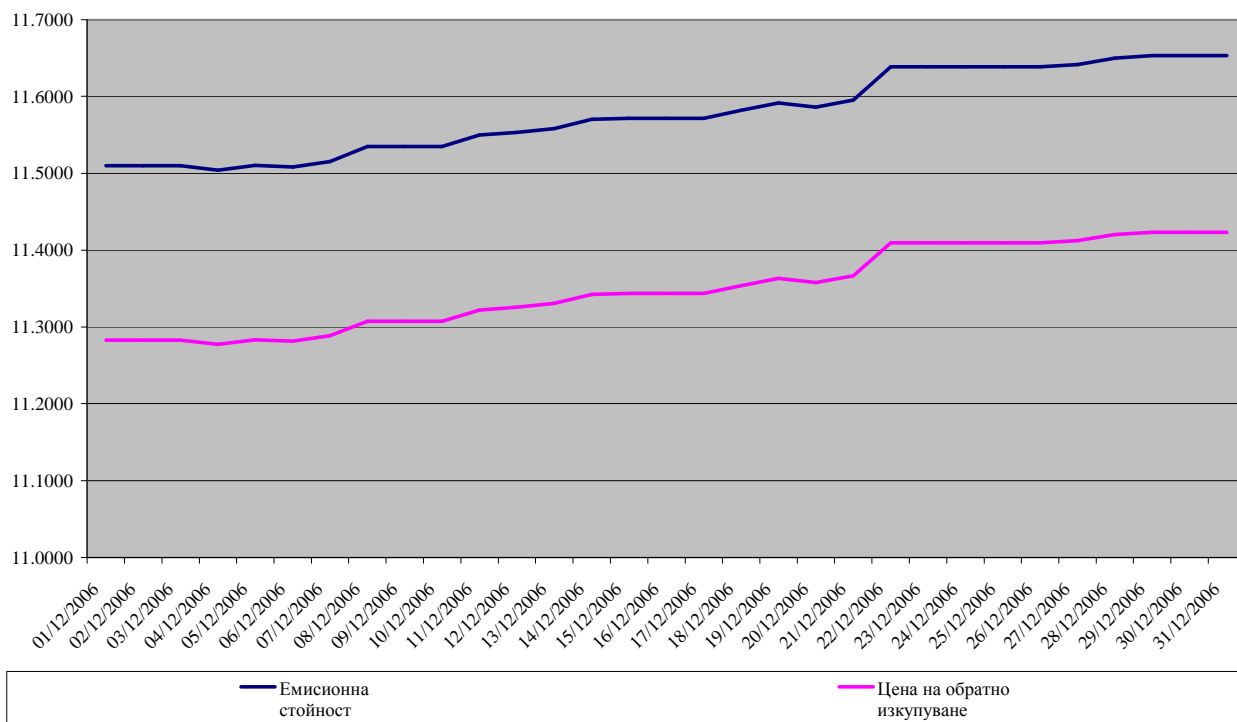
5) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 4: Данни за обявените емисионна стойност и цена на обратно изкупуване и датите на тяхното обявяване

Динамиката на емисионната стойност и цената на обратно изкупуване на дяловете на ДФ „Ти Би Ай Комфорт” за периода 01.12.2006–31.12.2006 е представена в таблицата и графиката по-долу:

Дата	Емисионна стойност	Цена на обратно изкупуване
03/01/2007	11.6531	11.4235
29/12/2006	11.6500	11.4204
28/12/2006	11.6417	11.4124
27/12/2006	11.6386	11.4093
22/12/2006	11.5950	11.3665
21/12/2006	11.5861	11.3578

20/12/2006	11.5917	11.3633
19/12/2006	11.5820	11.3537
18/12/2006	11.5715	11.3437
15/12/2006	11.5702	11.3422
14/12/2006	11.5582	11.3305
13/12/2006	11.5531	11.3255
12/12/2006	11.5496	11.3220
11/12/2006	11.5348	11.3075
08/12/2006	11.5154	11.2885
07/12/2006	11.5084	11.2816
06/12/2006	11.5102	11.2834
05/12/2006	11.5039	11.2772
04/12/2006	11.5097	11.2829
01/12/2006	11.5091	11.2823

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 25 023.9754 дяла.

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

Дата	Вид операция	Брой дялове	Цена	Сума в лева
05/12/2006	записване	69.5416	11.5039	800.00
06/12/2006	записване	2 085.8022	11.5102	24 008.00
07/12/2006	записване	597.4767	11.5084	6 876.00
11/12/2006	записване	6 963.2764	11.5348	80 320.00
12/12/2006	записване	2 077.9940	11.5496	24 000.00
13/12/2006	записване	1 320.3642	11.5531	15 254.30
19/12/2006	записване	8 634.0874	11.5820	100 000.00
20/12/2006	записване	189.7910	11.5917	2 200.00
21/12/2006	записване	517.8619	11.5861	6 000.00
22/12/2006	записване	129.3661	11.5950	1 500.00
27/12/2006	записване	34.3684	11.6386	400.00
28/12/2006	записване	858.9811	11.6417	10 000.00
29/12/2006	записване	1 545.0644	11.6500	18 000.00
ОБЩО:		25 023.9754		289 358.30

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 декември има обратно изкупени 24 660.8788 дяла от Фонда.

Дата	Вид операция	Брой дялове	Цена	Сума в лева
06/12/2006	обратно изкупуване	2 220.0000	11.2834	25 049.15
12/12/2006	обратно изкупуване	18 722.2403	11.3220	211 973.22
20/12/2006	обратно изкупуване	3 718.6385	11.3633	42 256.00
ОБЩО:		24 660.8788		279 278.37

В резултат на посочените по-горе записвания и обратни изкупувания, към 31.12.2006г. общият брой на дяловете на Фонда възлиза на 462 732.2693 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 изгъргувани ЦК	Сума в лева
01/12/2006	продажби	Корпоративни облигации	150	304 024
04/12/2006	покупки	Корпоративни облигации	100	203 934
11/12/2006	покупки	Корпоративни облигации	50	100 960
12/12/2006	продажби	Корпоративни облигации	80	160 801
19/12/2006	покупки	Лека промишленост	170	13 940
19/12/2006	продажби	Фармацевтична промишленост	4000	26 800

20/12/2006	покупки	Общински облигации	65	116 081
21/12/2006	покупки	Химическа промишленост	20	2 260
21/12/2006	продажби	Туризм	184	14 297
22/12/2006	продажби	Общински облигации	35	62 527
ОБЩО:			4 854	1 005 624

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