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

Към 31.03.2007г. корпоративните и общинските облигации представляват 41.81% 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 5.02 % от стойността на портфейла на Фонда.

Към 31.03.2007г. договорният фонд притежава акции, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 19.82% от общите активи на фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 32.69% от портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт, като около 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 0.55% от активите на Фонда към 31.03.2007г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.03.2007г. е 16.71% 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 нараства от 5 518 641 лева към 28.02.2007 г. до 5 651 317 лева към 31.03.2007г.

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		
	31/01/2007	28/02/2007	31/03/2007
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	203 594	336 024	539 886
Отрицателни курсови разлики	4	20	20
Разходи за външни услуги	6 329	11 749	17 500
Други финансови разходи	219	799	942
Общо разходи:	210 146	348 593	558 349

Общият размер на разходите на фонда към 31.03.2007г. е 558 349 лева, които включват 539 886 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и отрицателни валутни курсови разлики в размер на 20 лева.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 31 март 2007 – 16 523 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.30%

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

- към 31 март 2007 – 490 лв.

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

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 31 март 2007 – 600 лв.

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

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

- към 31 март 2007 – 104 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.002%

д) Други разходи

- към 31 март 2007 – 726 лв.

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

- Други разходи по финансови операции: 451 лв.

- Външни услуги (КФН и БФБ): 275 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 18 443 лв. към месец март. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 0.33%.

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

Долната таблица представя приходите на Фонда към 31.03.2007г. Приходите са в размер на 620 280 лева, включващи преоценка от операции с финансови активи и приходи от лихви и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лева		
	31/01/2007	28/02/2007	31/03/2007
Приходи от лихви	26 081	48 963	74 306
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	364 645	571 317	791 159
Други финансови приходи	0	0	650
Общо приходи:	390 726	620 280	866 115

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

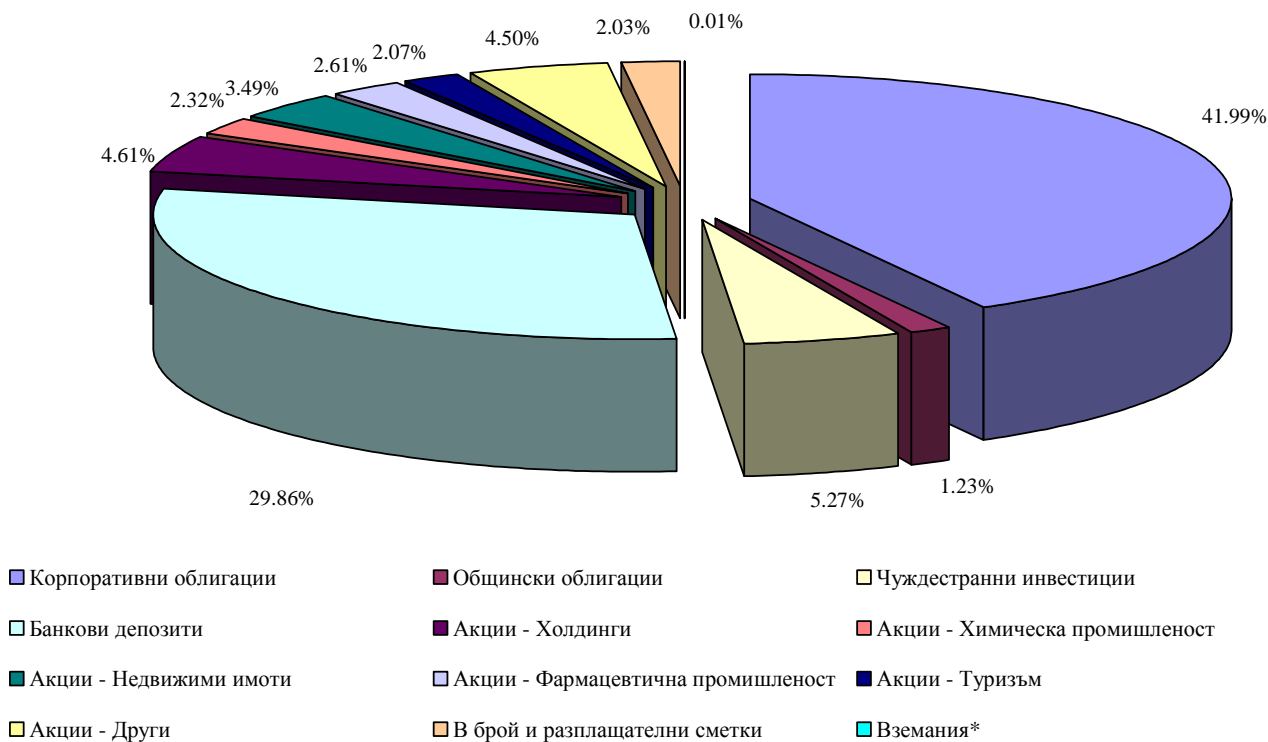
Структурата и обема на инвестициите в портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт в началото на периода са представени в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 28/02/2007		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Корпоративни облигации	2 317 034	41.99%
BG2100014054	152 952	2.77%
BG2100002034	206 418	3.74%
BG2100007058	119 218	2.16%
BG2100018055	38 481	0.70%
BG2100017040	172 268	3.12%
BG2100036057	183 324	3.32%
BG2100032056	158 721	2.88%
BG2100017065	61 219	1.11%
BG2100027056	60 279	1.09%
BG2100031066	199 339	3.61%
BG2100030068	250 148	4.53%
BG2100001051	30 366	0.55%
BG2100037063	40 843	0.74%
BG2100024061	257 523	4.67%
BG2100019061	80 714	1.46%
BG2100014062	205 887	3.73%
BG2100001077	99 335	1.80%
Общински облигации	68 034	1.23%
BG2100007041	13 733	0.25%
BG2100003057	54 300	0.98%
Чуждестранни инвестиции	290 895	5.27%
DE000SG2J8T5	196 678	3.56%
XS0252187959	94 216	1.71%

Банкови депозити	1 648 064	29.86%
Акции - Холдинги	254 631	4.61%
BG1100046983	120 998	2.19%
BG1100005971	69 950	1.27%
BG1100019980	63 683	1.15%
Акции - Химическа промишленост	128 297	2.32%
BG11ORRUAT13	111 264	2.02%
BG11KAGAAT13	17 032	0.31%
Акции - Недвижими имоти	192 536	3.49%
BG1100025052	13 152	0.24%
BG1100019055	19 802	0.36%
BG1100030052	16 590	0.30%
BG1100042057	73 942	1.34%
BG1100109039	69 050	1.25%
Акции - Фармацевтична промишленост	143 885	2.61%
BG11BAKABT17	84 977	1.54%
BG11SOSOBT18	58 908	1.07%
Акции - Туризм	114 425	2.07%
BG11ALBAAT17	114 425	2.07%
Акции - Тютюнева промишленост	31 580	0.57%
BG11BLBLAT13	10 505	0.19%
BG11SOSOV14	21 075	0.38%
Акции - Телекомуникации	9 305	0.17%
BG1100005997	9 305	0.17%
Акции - Финанси	31 625	0.57%
BG1100098059	31 625	0.57%
Акции - Тежка промишленост	97 412	1.77%
BG1100075065	97 412	1.77%
Акции - Търговия	78 419	1.42%
BG11TOSOAT18	78 419	1.42%
В брой и разплащателни сметки	112 001	2.03%
Вземания*	500	0.01%
Обща сума	5 518 641	100.00%

* Вземания във връзка с платена такса за поддържане на емисия на БФБ - София АД.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 28/02/2007



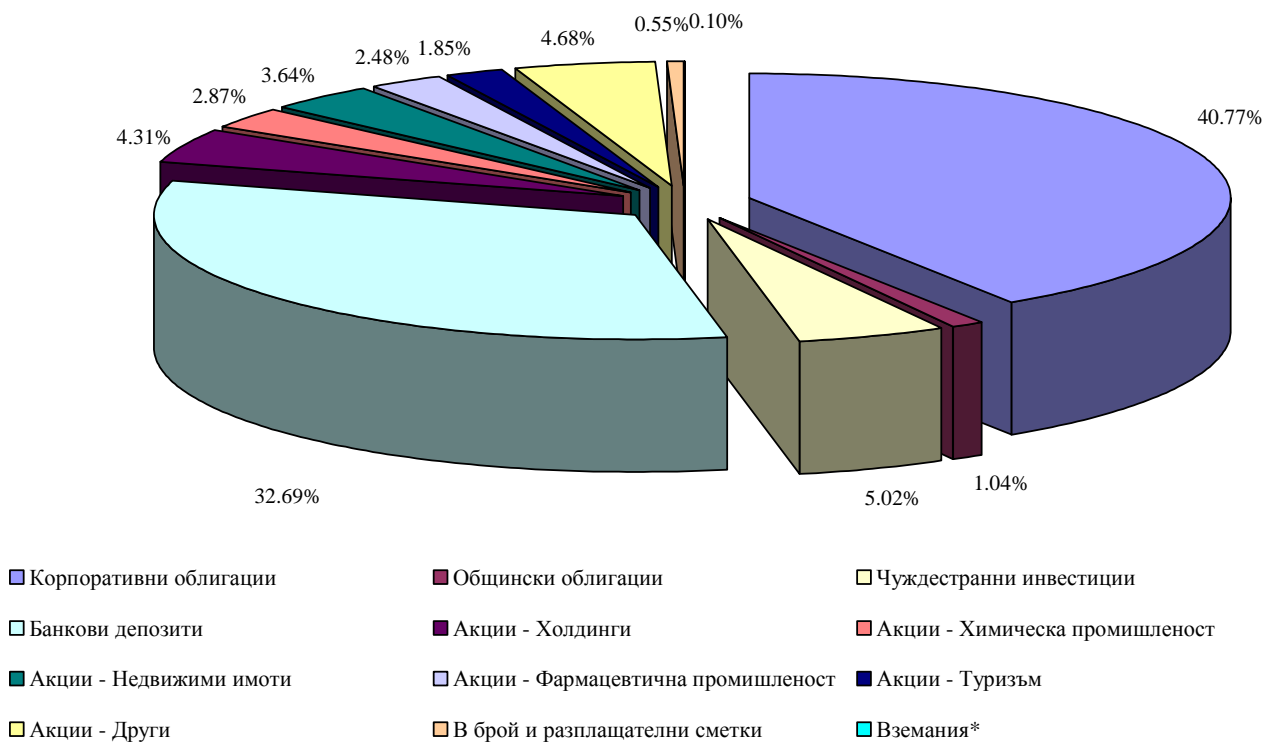
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт в края на периода е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Комфорт към 31/03/2007		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Корпоративни облигации	2 304 015	40.77%
BG2100014054	183 916	3.25%
BG2100002034	197 942	3.50%
BG2100007058	119 876	2.12%
BG2100018055	38 694	0.68%
BG2100017040	173 306	3.07%
BG2100036057	184 370	3.26%
BG2100032056	159 234	2.82%
BG2100017065	61 587	1.09%
BG2100027056	60 633	1.07%
BG2100031066	200 551	3.55%
BG2100030068	150 991	2.67%
BG2100001051	30 530	0.54%
BG2100037063	41 098	0.73%
BG2100024061	254 735	4.51%
BG2100019061	80 305	1.42%
BG2100014062	206 339	3.65%
BG2100001077	159 906	2.83%
Общински облигации	58 888	1.04%

	BG2100007041	13 806	0.24%
	BG2100003057	45 082	0.80%
Чуждестранни инвестиции		283 783	5.02%
	DE000SG2J8T5	194 754	3.45%
	XS0252187959	89 029	1.58%
Банкови депозити		1 847 433	32.69%
Акции - Холдинги		243 445	4.31%
	BG1100046983	108 674	1.92%
	BG1100005971	75 117	1.33%
	BG1100019980	59 654	1.06%
Акции - Химическа промишленост		162 018	2.87%
	BG11ORRUAT13	144 491	2.56%
	BG11KAGAAT13	17 526	0.31%
Акции - Недвижими имоти		205 603	3.64%
	BG1100025052	13 920	0.25%
	BG1100019055	21 293	0.38%
	BG1100030052	16 380	0.29%
	BG1100042057	83 946	1.49%
	BG1100109039	70 064	1.24%
Акции - Фармацевтична промишленост		140 259	2.48%
	BG11BAKABT17	81 431	1.44%
	BG11SOSOBT18	58 828	1.04%
Акции - Туризъм		104 312	1.85%
	BG11ALBAAT17	104 312	1.85%
Акции - Тютюнева промишленост		29 668	0.52%
	BG11BLBLAT13	9 998	0.18%
	BG11SOSOV14	19 670	0.35%
Акции - Телекомуникации		9 350	0.17%
	BG1100005997	9 350	0.17%
Акции - Финанси		66 255	1.17%
	BG1100098059	31 781	0.56%
	BG1100114062	34 475	0.61%
Акции - Тежка промишленост		96 323	1.70%
	BG1100075065	96 323	1.70%
Акции - Търговия		54 923	0.97%
	BG11TOSOAT18	54 923	0.97%
Акции - Лека промишленост		8 203	0.15%
	BG11EMSEAT19	8 203	0.15%
В брой и разплащателни сметки		31 281	0.55%
Вземания*		5 559	0.10%
Обща сума		5 651 317	99.85%

* Вземания във връзка с авансово платена такса за поддържане на емисия на БФБ - София АД и вземане за лихвено плащане на емисия корпоративни облигации.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Комфорт към 31/03/2007



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

Към 28 февруари 2007г. друг актив на Фонда представлява вземане в размер на 500 лв., свързано с авансово платена такса за поддържане на емисия на БФБ – София АД.

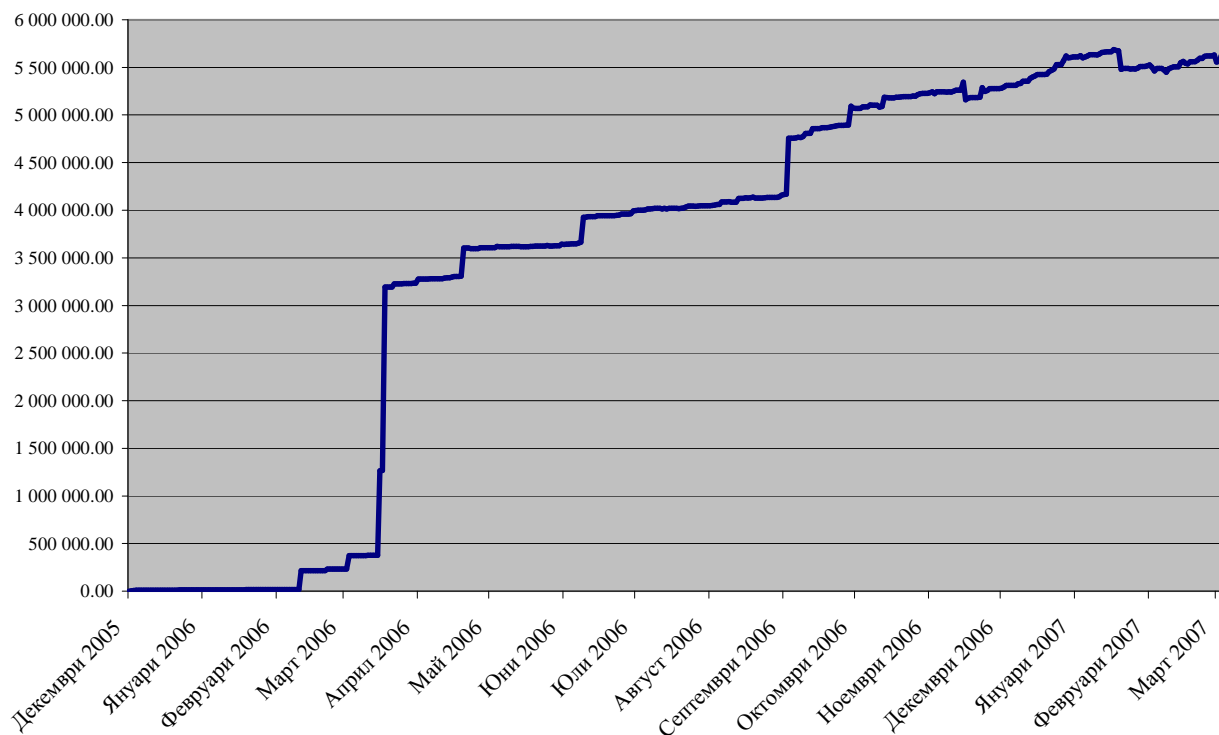
Към 31 март 2007г. друг актив на Фонда представлява вземане в размер на 452 лв., свързано с авансово платена такса за поддържане на емисия на БФБ – София АД и вземане в размер на 5107, свързано с лихвено плащане по емисия корпоративни облигации от портфейла на ФОНДА.

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

На 28.02.2007 г. е изчислена нетна стойност на активите в размер на 5 502 036 лв. Към 31.03.2007 г. нетната стойност на активите е 5 641 088 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 5 551 936 лева. Средната годишна нетна стойност на активите е 5 532 387 лева.

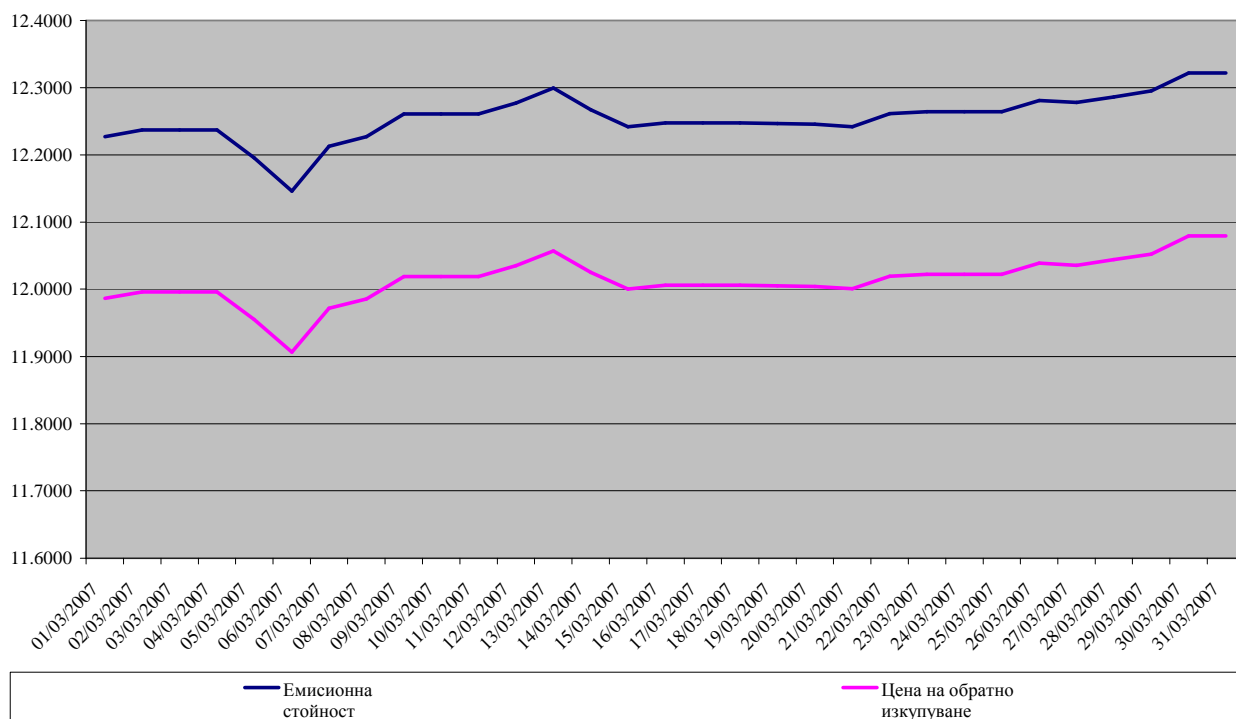
5) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 4: Данни за обявените емисионна стойност и цена на обратно изкупуване и датите на тяхното обявяване

Динамиката на емисионната стойност и цената на обратно изкупуване на дяловете на ДФ „Ти Би Ай Комфорт” за периода 01.03.2007–01.04.2007 е представена в таблицата и графиката по-долу:

Дата	Емисионна стойност	Цена на обратно изкупуване
02/04/2007	12.3221	12.0793
30/03/2007	12.2948	12.0525
29/03/2007	12.2860	12.0439
28/03/2007	12.2777	12.0358
27/03/2007	12.2807	12.0387
26/03/2007	12.2640	12.0224
23/03/2007	12.2613	12.0197

22/03/2007	12.2420	12.0008
21/03/2007	12.2456	12.0043
20/03/2007	12.2466	12.0053
19/03/2007	12.2473	12.0060
16/03/2007	12.2418	12.0006
15/03/2007	12.2670	12.0253
14/03/2007	12.2996	12.0572
13/03/2007	12.2769	12.0350
12/03/2007	12.2606	12.0190
09/03/2007	12.2268	11.9859
08/03/2007	12.2124	11.9717
07/03/2007	12.1457	11.9064
06/03/2007	12.1956	11.9553
05/03/2007	12.2370	11.9959
02/03/2007	12.2273	11.9864
01/03/2007	12.2433	12.0021

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 18 994.4016 дяла.

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

Дата	Вид операция	Брой дялове	Цена	Сума в лева
02/03/2007	записване	2 453.5261	12.2273	30 000.00
06/03/2007	записване	8.1997	12.1956	100.00
07/03/2007	записване	494.0020	12.1457	6 000.00
08/03/2007	записване	163.7680	12.2124	2 000.00
12/03/2007	записване	3 132.9462	12.2606	38 411.80
14/03/2007	записване	16.2607	12.2996	200.00
15/03/2007	записване	306.3993	12.2670	3 758.60
16/03/2007	записване	2 368.9327	12.2418	29 000.00
19/03/2007	записване	1 534.9162	12.2473	18 798.58
20/03/2007	записване	1 546.5517	12.2466	18 940.00
22/03/2007	записване	1 278.3622	12.2420	15 649.71
26/03/2007	записване	122.3092	12.2640	1 500.00
28/03/2007	записване	366.5182	12.2777	4 500.00
29/03/2007	записване	4 883.6074	12.2860	60 000.00
30/03/2007	записване	318.1020	12.2948	3 911.00
ОБЩО:		18 994.4016		232 769.69

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 март има обратно изкупени 10 455.3022 дяла от Фонда.

Дата	Вид операция	Брой дялове	Цена	Сума в лева
01/03/2007	обратно изкупуване	2 777.7778	12.0021	33 339.17
02/03/2007	обратно изкупуване	395.2392	11.9864	4 737.50
05/03/2007	обратно изкупуване	10.0000	11.9960	119.96
09/03/2007	обратно изкупуване	223.0922	11.9859	2 673.96
14/03/2007	обратно изкупуване	496.1930	12.0572	5 982.70
16/03/2007	обратно изкупуване	500.0000	12.0006	6 000.30
27/03/2007	обратно изкупуване	5 883.0000	12.0387	70 823.67
29/03/2007	обратно изкупуване	170.0000	12.0439	2 047.46
ОБЩО:		10 455.3022		125 724.72

В резултат на посочените по-горе записвания и обратни изкупувания, към 31.03.2007г. общият брой на дяловете на Фонда възлиза на 464 669.6808 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
01/03/2007	покупки	Корпоративни облигации	30	59 024
06/03/2007	покупки	Акции - Лека промишленост	213	6 603
07/03/2007	покупки	Акции - Финанси	10 575	31 907
19/03/2007	покупки	Корпоративни облигации	30	30 709
27/03/2007	продажби	Корпоративни облигации	50	100 641
30/03/2007	покупки	Права - Недвижими имоти	637	57
30/03/2007	продажби	Акции - Недвижими имоти	3	12
ОБЩО:			11 538	228 954

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