
**ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО ЧЛ. 18 ОТ НАРЕДБА № 26 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА
КЪМ ДЕЙНОСТТА НА УПРАВЛЯВАЩИТЕ ДРУЖЕСТВА
ЗА ДОГОВОРЕН ФОНД „ТИ БИ АЙ ДИНАМИК”**

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 акции, търгувани на регулираните пазари в страната и чужбина, през периода продължават покупките и/ или продажбите на акции от български публични дружества, търгувани на БФБ – София АД.

Към 31.05.2006 г. акциите в портфейла на Фонда са разпределени в 10 сектора. Общият дял на акциите в общите активи на Фонда към 31.05.2006г. възлиза на 55.40%.

През месец май са закупени чуждестранни ценни книжа, които дават експозиция към доходността на акции на международни компании - сини чипове. Тези инвестиции представляват 4.84% от стойността на портфейла на Фонда.

Корпоративните облигации представляват 9.65 % от стойността на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик и са деноминирани в евро.

Банковите депозити съставляват 26.63 % от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.05.2006г. са 0.24% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с участието в капитала на дружество със специална инвестиционна цел в процес на учредяване, както и авансово платени такси за БФБ – София АД представляват 3.25% от активите.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.05.2006г. е 10.25% на годишна база. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е 8.47%.

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 намалява от 4 666 816 лева към 30.04.2006г. до 4 641 370 лева към 31.05.2006г.

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:

Разходи	Стойност в лв.		
	31/03/2006	30/04/2006	31/05/2006
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	120 422	140 349	270 567
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	14	54	128
Други разходи	1 375	1 900	2 654
Разходи за външни услуги	8 714	13 831	21 917
Общо разходи	130 525	156 135	295 265

Общият размер на разходите на фонда към 31.05.2006 г. е 295 265 лева, които включват 270 567 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 128 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове. Последните не са част от “всички разходи, свързани с дейността на дружеството” по чл. 171 ЗППЦК.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 31 май 2006г. – 19 819 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.74%

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

- към 31 май 2006г. – 1 412 лв.

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

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 31 май 2006г. – 1000 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 май 2006г. – 173 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.006%

д) Други разходи

- към 31 май 2006г. – 2166 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.08%

- Други разходи по финансови операции: 1241 лв.

- Външни услуги (КФН и БФБ): 925 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 24 570 лв. към месец май. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 0.92 %.

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

Долната таблица представя приходите на Фонда към 31.05.2006. Приходите са в размер на 412 788 лв, включващи приходи от операции с финансови активи и приходи от лихви.

Приходи	Стойност в лв.		
	31/03/2006	30/04/2006	31/05/2006
Приходи от лихви	5 345	9 547	18 895
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	183 106	236 629	391 024
Други финансови приходи			2 870
Общо приходи	188 451	246 176	412 788

II. Данни по чл. 18, ал. 2

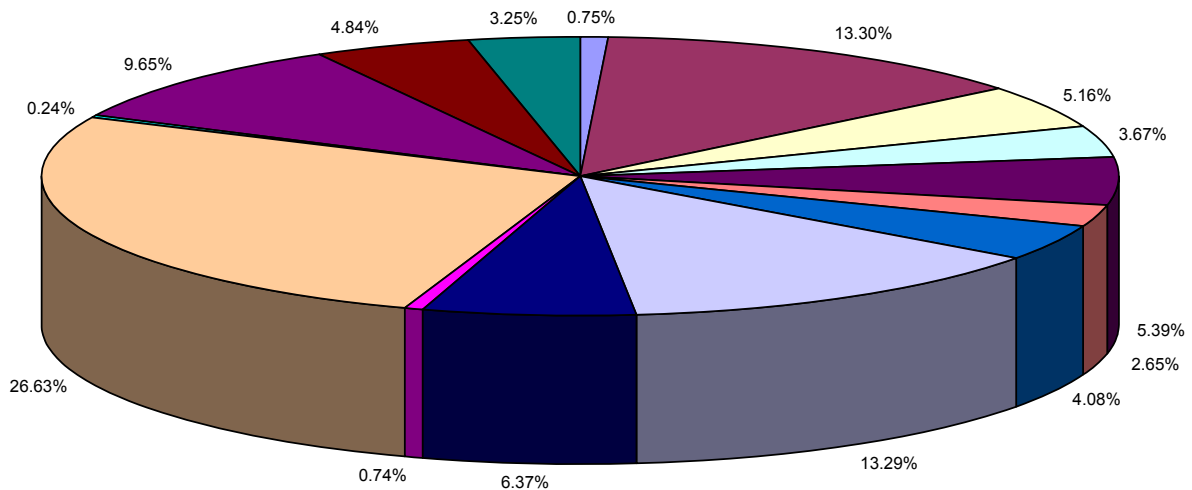
1) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла в началото и в края на отчетния период

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик в края на отчетния период е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31/05/2006		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции -Тежка промишленост	34 758	0.75%
Акции - Холдинги	617 324	13.30%
Акции - Тютюнева промишленост	239 638	5.16%
Акции - Електроника	170 110	3.67%
Акции - Туризм	250 269	5.39%
Акции - Фармацевтична промишленост	122 912	2.65%
Акции - Химическа промишленост	189 153	4.08%
Акции - Недвижими имоти	617 046	13.29%
Акции - Телекомуникации	295 834	6.37%
Акции - Финанси	34 240	0.74%
Банкови депозити	1 235 895	26.63%
В брой и разплащателни сметки	11 254	0.24%
Корпоративни облигации	447 663	9.65%
Чуждестранни инвестиции	224 654	4.84%
Вземания*	150 619	3.25%
Обща сума	4 641 370	100.00%

*Вземанията са във връзка с участието в капитала на дружество със специална инвестиционна цел в процес на учредяване, авансово платена такса за поддържане на емисия на БФБ – София АД и годишна такса на Комисията за финансов надзор.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/05/2006



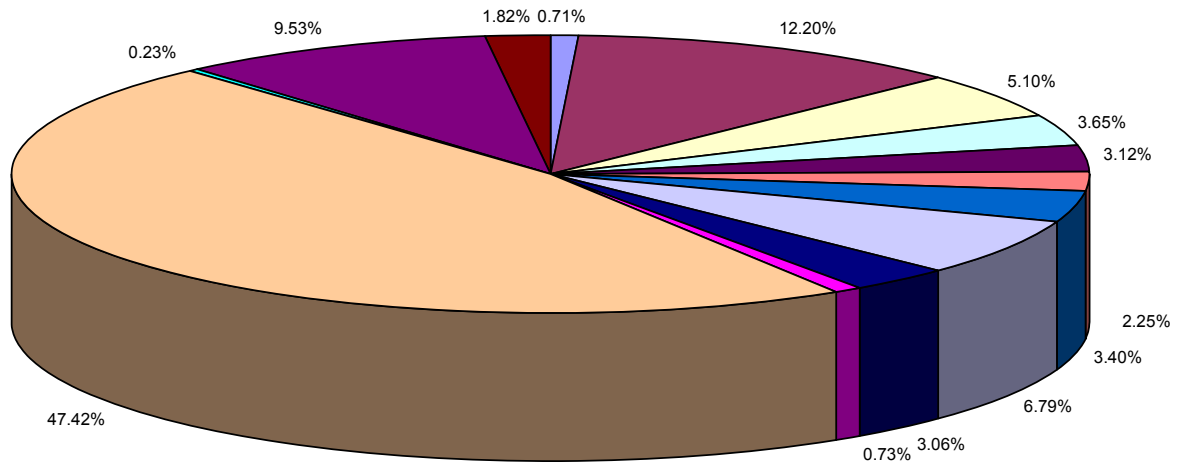
Акции - Тежка промишленост	Акции - Холдинги
Акции - Тютюнева промишленост	Акции - Електроника
Акции - Туризм	Акции - Фармацевтична промишленост
Акции - Химическа промишленост	Акции - Недвижими имоти
Акции - Телекомуникации	Акции - Финанси
Банкови депозити	В брой и разплащателни сметки
Корпоративни облигации	Чуждестранни инвестиции
Вземания*	

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

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 30/04/2006		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции -Тежка промишленост	33 147	0.71%
Акции - Холдинги	569 348	12.20%
Акции - Тютюнева промишленост	237 983	5.10%
Акции - Електроника	170 110	3.65%
Акции - Туризм	145 514	3.12%
Акции - Фармацевтична промишленост	105 227	2.25%
Акции - Химическа промишленост	158 571	3.40%
Акции - Недвижими имоти	316 836	6.79%
Акции - Телекомуникации	142 637	3.06%
Акции - Финанси	34 240	0.73%
Банкови депозити	2 213 011	47.42%
В брой и разплащателни сметки	10 559	0.23%
Корпоративни облигации	444 646	9.53%
Вземания *	84 985	1.82%
Обща сума	4 666 816	100.00%

* Вземания във връзка със записването на акции от увеличението на капитала на две дружества, търгувани на БФБ-София АД, и авансово платена такса за поддържане на емисия на БФБ – София АД и годишна такса за КФН.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 30/04/2006



Акции - Тежка промишленост	Акции - Холдинги
Акции - Тютюнева промишленост	Акции - Електроника
Акции - Туризъм	Акции - Фармацевтична промишленост
Акции - Химическа промишленост	Акции - Недвижими имоти
Акции - Телекомуникации	Акции - Финанси
Банкови депозити	В брой и разплащателни сметки
Корпоративни облигации	Вземания *

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

Към 30 април 2006г. други активи на Фонда представляват вземания, свързани със записване на акции от увеличение на капитала на две дружества, търгувани на БФБ – София АД. Друг актив на дружеството е и сумата в размер на 957 лв. – авансово платена такса за поддържане на емисия на БФБ – София АД и годишна такса на Комисията за финансов надзор.

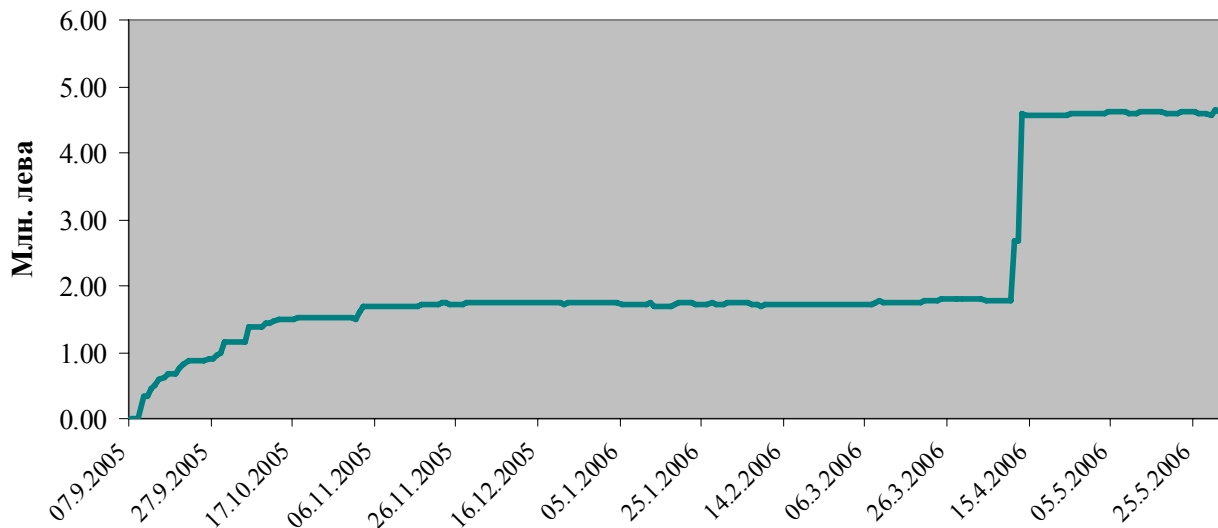
Към 31 май 2006г. други активи на Фонда представляват вземания, свързани със участието в капитала на дружество със специална инвестиционна цел в процес на учредяване. Друг актив на дружеството е и сумата в размер на 619 лв. – авансово платена такса за поддържане на емисия на БФБ – София АД и годишна такса на Комисията за финансов надзор.

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

На 30.04.2006г. е изчислена нетна стойност на активите в размер на 4 605 274 лв. Към 31.05.2006г. нетната стойност на активите нараства до 4 632 459 лв.

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

Нетна стойност на активите на Ти Би Ай Динамик



4) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 3: Средна месечна и средна годишна нетна стойност на активите на Фонда

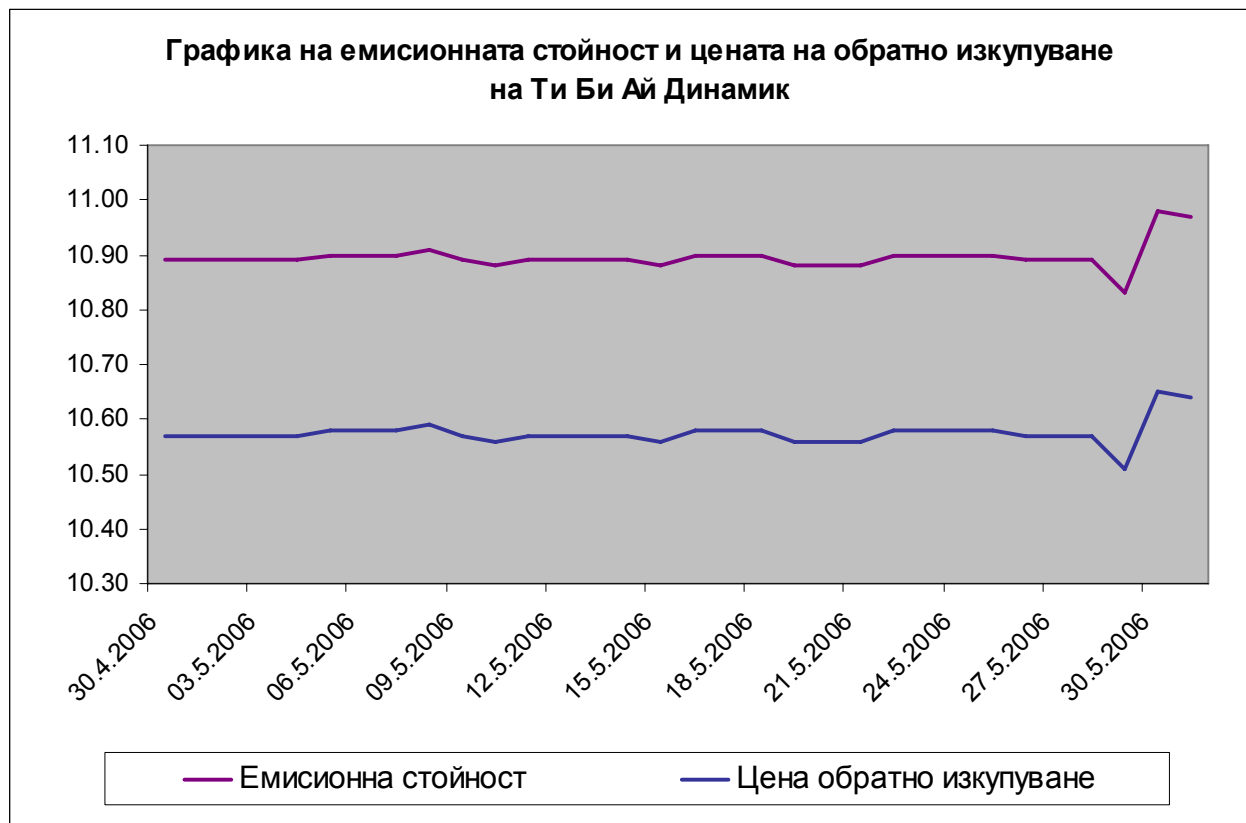
Средната месечна нетна стойност на активите на Фонда е 4 607 577 лева.
Средната годишна нетна стойност на активите е 2 680 439 лева.

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 Динамик” за периода 01/05/2006 – 31/05/2006 е представена в таблицата и графиката и по-долу:

Дата	Емисионна стойност	Цена обратно изкупуване
01.6.2006	10.97	10.64
31.5.2006	10.98	10.65
30.5.2006	10.83	10.51
29.5.2006	10.89	10.57
26.5.2006	10.90	10.58
25.5.2006	10.90	10.58
23.5.2006	10.90	10.58

22.5.2006	10.88	10.56
19.5.2006	10.90	10.58
18.5.2006	10.90	10.58
17.5.2006	10.90	10.58
16.5.2006	10.88	10.56
15.5.2006	10.89	10.57
12.5.2006	10.89	10.57
11.5.2006	10.88	10.56
10.5.2006	10.89	10.57
09.5.2006	10.91	10.59
08.5.2006	10.90	10.58
05.5.2006	10.89	10.57
04.5.2006	10.89	10.57
03.5.2006	10.89	10.57
02.5.2006	10.89	10.57



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

През месец май са записани 2 817.7587 дяла.

Таблицата по-долу представя продажбата на дялове на ДФ Ти Би Ай Динамик за месец май.

Дата	Операция	Брой дялове	Емисионна цена	Сума лв.
03.5.2006	записване	596.8778	10.89	6 500.00
04.5.2006	записване	174.4720	10.89	1 900.00
05.5.2006	записване	123.0487	10.89	1 340.00
11.5.2006	записване	68.8705	10.89	750.00
12.5.2006	записване	1 485.9504	10.89	16 182.00
22.5.2006	записване	45.9559	10.88	500.00
23.5.2006	записване	45.8716	10.90	500.00
25.5.2006	записване	45.8715	10.90	500.00
30.5.2006	записване	230.8403	10.83	2 500.00
ОБЩО:		2 817.7587		30 672.00

7) Данни по чл. 53, ал. 2 т. 6: Брой и цени на изкупените обратно дялове

През месец май са изкупени обратно 2843 дяла.

Таблицата по-долу представя обратното изкупуване на дялове на ДФ Ти Би Ай Динамик за месец май.

Дата	Операция	Брой дялове	Цена на обратно изкупуване	Сума лв.
03.5.2006	обратно изкупуване	423.0000	10.57	4 471.11
05.5.2006	обратно изкупуване	51.0000	10.57	539.07
09.5.2006	обратно изкупуване	500.0000	10.59	5 295.00
11.5.2006	обратно изкупуване	39.0000	10.56	411.84
15.5.2006	обратно изкупуване	279.0000	10.57	2 949.03
16.5.2006	обратно изкупуване	443.0000	10.56	4 678.08
18.5.2006	обратно изкупуване	1 000.0000	10.58	10 580.00
30.5.2006	обратно изкупуване	71.0000	10.51	746.21
31.5.2006	обратно изкупуване	37.0000	10.65	394.05
ОБЩО:		2 843.0000		30 064.39

В резултат на посочените по-горе записвания и обратни изкупувания, към 31.05.2006г. общият брой на дяловете на Фонда възлиза на 431 042.1302 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 Динамик за отчетния период.

Дата	Вид сделки	Сектори	Общ брой изтъргувани ЦК	Обща стойност на сделките
02.5.2006	покупки	Туризм, Фармацевтична промишленост, Холдинги	5988	33 160
04.5.2006	покупки	Туризм, Фармацевтична промишленост, Холдинги	1 239	27 396
05.5.2006	покупки	Туризм, Фармацевтична промишленост, Холдинги	460	12 379
08.5.2006	покупки	Холдинги, Телекомуникации	6 095	64 877
09.5.2006	покупки	Фармацевтична промишленост, Химическа промишленост	3579	55771.7
10.5.2006	покупки	Телекомуникации	500	5 250
11.5.2006	покупки	Телекомуникации, Тютюнева промишленост, Туризм	2 899	58 256
15.5.2006	покупки	Холдинги, Туризм	171	4 037
16.5.2006	покупки	Холдинги	2 074	29 118
17.5.2006	покупки	Холдинги, Туризм	390	7 022
18.5.2006	продажби	Холдинги	3 000	51 600
19.5.2006	продажби	Холдинги	1 350	23 133
22.5.2006	покупки	Недвижими имоти, Туризм	135 100	206 300
23.5.2006	покупки	Холдинги, Туризм, Телекомуникации	6 370	96 471
25.5.2006	покупки	Тютюнева промишленост, Туризм	169	12 936
30.5.2006	продажби	Телекомуникации	20 100	220 698
ОБЩО:			189 484	908 405

За Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Стоян Тошев,

Изпълнителен директор