
**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 29.09.2006 г. акциите на български компании в портфейла на Фонда са разпределени в 9 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 29.09.2006г. възлиза на 60.91%.

Чуждестранните ценни книжа, които дават експозиция към доходността на акции на международни компании - сини чипове и компании от развиващите се пазари, представляват 12.83% от стойността на портфейла на Фонда.

Корпоративните облигации представляват 1.60 % от стойността на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик и са деноминирани в евро.

Банковите депозити съставляват 21.21% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 29.09.2006г. са 0.83% от стойността на портфейла.

Вземания във връзка със записването на акции от увеличението на капитала на дружество, търгувано на БФБ-София АД, продажба на права, начислени дивиденди и авансово платена такса на КФН., представляват 2.61% от активите.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.09.2006г. е 12.32% на годишна база*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е 15.03%.

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 5 745 486 лева към 31.08.2006г. до 6 243 084 лева към 29.09.2006г.

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		
	31/07/2006	31/08/2006	29/09/2006
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	432 959	736 007	952 769
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	152	185	324
Други разходи	3 880	4 165	5 212
Разходи за външни услуги	38 947	48 042	56 636
Общо разходи	475 938	788 399	1 014 941

Общият размер на разходите на фонда към 29.09.2006 г. е 1 014 941 лева, които включват 952 769 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 324 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 29 септември 2006г. – 52 771 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.33 %

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

- към 29 септември 2006г. – 3 005 лв.

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

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 29 септември 2006г. – 1 800 лв.

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

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

- към 29 септември 2006г. – 316 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.008%

д) Други разходи

- към 29 септември 2006г. – 3 956 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.1%

- Други разходи по финансови операции: 2 207 лв.

- Външни услуги (КФН и БФБ): 1 749 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 61 848 лв. към месец септември. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 1.56 %.

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

Долната таблица представя приходите на Фонда към 29.09.2006. Приходите са в размер на 1 431 153 лв, включващи приходи от операции с финансови активи, приходи от лихви и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лева		
	31/07/2006	31/08/2006	29/09/2006
Приходи от лихви	36 375	43 154	48 337
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	659 403	1 038 508	1 338 449
Други финансови приходи	30 409	44 367	44 367
Общо приходи	726 186	1 126 029	1 431 153

II. Данни по чл. 18, ал. 2

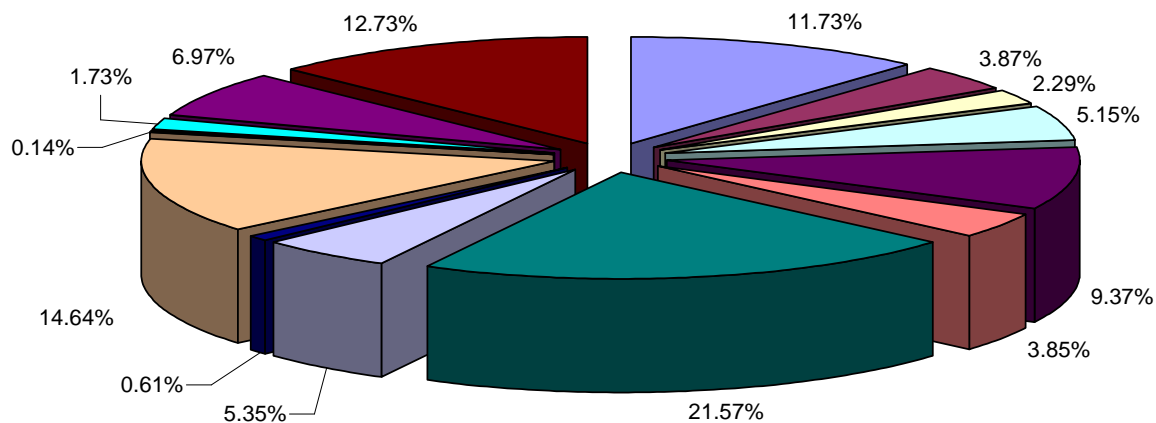
1) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла в началото и в края на отчетния период

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

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31/08/2006		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	673 960	11.73%
BG1100046983	304 863	5.31%
BG11BUSOGT14	160	0.00%
BG1100005971	55 169	0.96%
BG1100019980	313 767	5.46%
Акции - Тютюнева промишленост	222 140	3.87%
BG11BLBLAT13	74 798	1.30%
BG11SOSOV14	147 342	2.56%
Акции - Електроника	131 586	2.29%
BG11ELPAB16	131 586	2.29%
Акции - Туризм	295 726	5.15%
BG11ALBAAT17	295 726	5.15%
Акции - Фармацевтична промишленост	538 082	9.37%
BG11BAKAB17	246 759	4.29%
BG11SOSOB18	291 323	5.07%
Акции - Химическа промишленост	221 319	3.85%
BG11ORRUAT13	221 319	3.85%
Акции и права - Недвижими имоти	1 239 128	21.57%
BG1100003059	76 500	1.33%
BG1100025052	34 524	0.60%
BG1100030052	100 252	1.74%
BG1100042057	251 777	4.38%
BG1100109039	428 275	7.45%
РИИТ АДСИЦ	150 000	2.61%
BG1100019055	23 117	0.40%
Health and Wellness АДСИЦ	150 000	2.61%
BG4000033069	24 683	0.43%
Акции - Телекомуникации	307 521	5.35%
BG1100005997	307 521	5.35%
Акции - Финанси	35 182	0.61%
BG1100098059	35 182	0.61%
Банкови депозити	841 345	14.64%
В брой и разплащателни сметки	8 076	0.14%
Корпоративни облигации	99 654	1.73%
BG2100027056	99 654	1.73%
Чуждестранни инвестиции	400 210	6.97%
DE000SG2J8T5	238 079	4.14%
XS0252187959	162 130	2.82%
Вземания*	731 557	12.73%
Обща сума	5 745 486	100.00%

* Вземания във връзка с продажба на права, начислени дивиденди и падеж на депозит, от който паричните средства постъпват на следващия ден - 01/09/2006.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/08/2006



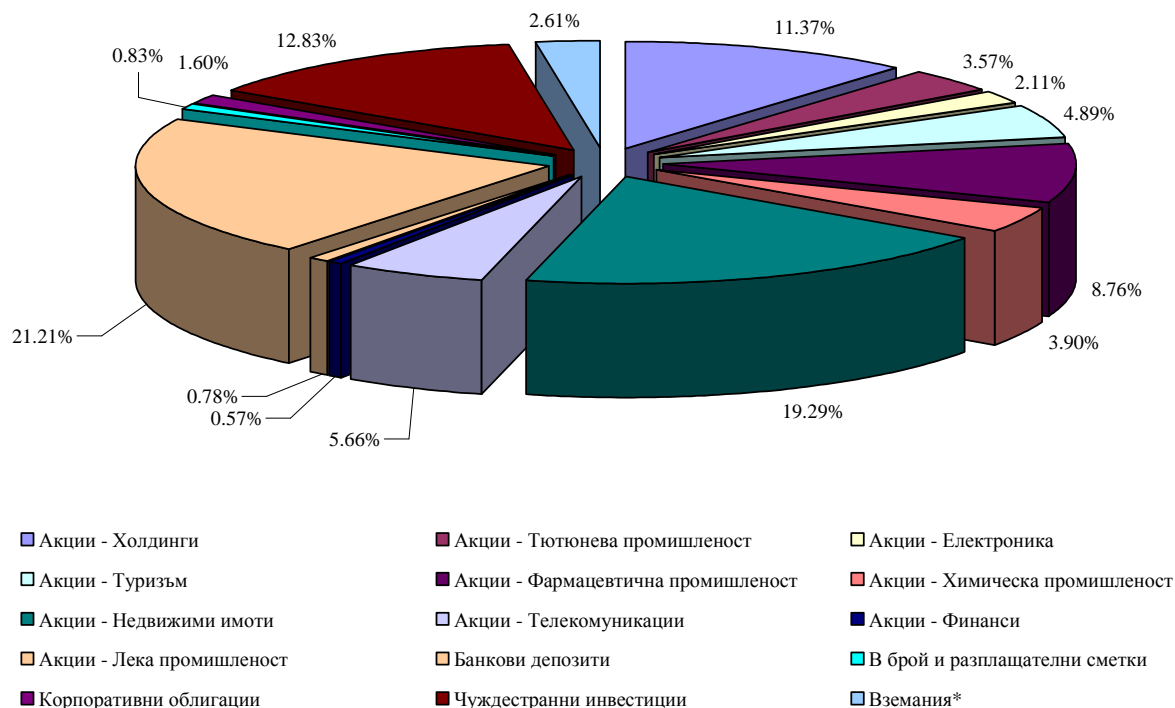
- | | |
|--------------------------------------|----------------------------------|
| ■ Акции - Холдинги | ■ Акции - Тютюнева промишленост |
| ■ Акции - Електроника | ■ Акции - Туризм |
| ■ Акции - Фармацевтична промишленост | ■ Акции - Химическа промишленост |
| ■ Акции - Недвижими имоти | ■ Акции -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

Структурата 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 29/09/2006		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	653 671	10.47%
BG1100046983	337 541	5.41%
BG11BUSOGT14	158	0.00%
BG1100005971	59 891	0.96%
BG1100019980	256 081	4.10%
Акции - Тютюнева промишленост	369 083	5.91%
BG11BLBLAT13	76 404	1.22%
BG11SOSOV14	292 679	4.69%
Акции - Електроника	48 750	0.78%
BG11ELPAB16	48 750	0.78%
Акции - Туризм	305 484	4.89%
BG11ALBAAT17	305 484	4.89%
Акции - Фармацевтична промишленост	498 634	7.99%
BG11BAKAB17	393 512	6.30%
BG11SOSOB18	105 122	1.68%
Акции - Химическа промишленост	312 561	5.01%
BG11ORRUAT13	312 561	5.01%
Акции и права - Недвижими имоти	1 225 848	19.64%
BG1100003059	72 500	1.16%
BG1100025052	35 346	0.57%
BG1100030052	131 846	2.11%
BG1100042057	103 092	1.65%
BG1100109039	146 416	2.35%
РИИТ АДСИЦ	412 026	6.60%
BG1100019055	25 417	0.41%
Health and Wellness АДСИЦ	150 000	2.40%
BG4000033069	149 205	2.39%
Акции - Телекомуникации	353 065	5.66%
BG1100005997	353 065	5.66%
Акции - Финанси	35 663	0.57%
BG1100098059	35 663	0.57%
Банкови депозити	1 324 135	21.21%
В брой и разплащателни сметки	52 015	0.83%
Корпоративни облигации	100 194	1.60%
BG2100027056	100 194	1.60%
Чуждестранни инвестиции	800 772	12.83%
DE000SG2J8T5	245 965	3.94%
XS0252187959	163 992	2.63%
XS0267513736	390 814	6.26%
Вземания*	163 210	2.61%
Обща сума	6 243 084	100.00%

* Вземания във връзка със записването на акции от увеличението на капитала на дружество, търгувано на БФБ-София АД, продажба на права, начислени дивиденди и авансово платена такса на КФН.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 30/09/2006



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

Към 31 август 2006г. други активи на Фонда представляват вземания, свързани с продажба на права, начислени дивиденди и падеж на депозит, от който паричните средства постъпват на следващия ден - 01/09/2006. Друг актив на дружеството е и сумата в размер на 215 лв. – авансово платена такса за поддържане на емисия на БФБ – София АД.

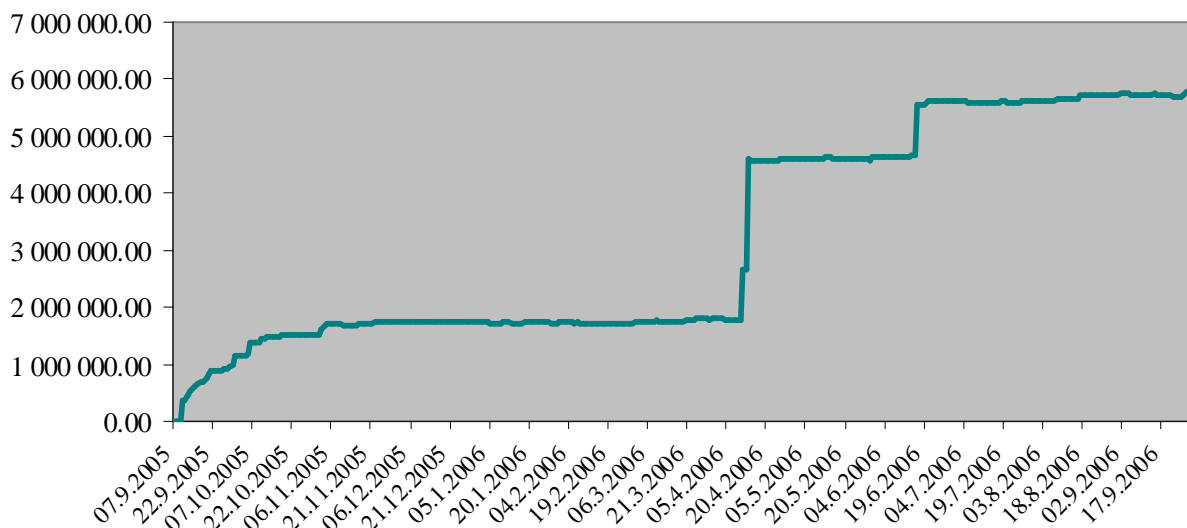
Към 29 септември 2006г. други активи на Фонда представляват вземане във връзка със записването на акции от увеличението на капитала на дружество, търгувано на БФБ-София АД, продажба на права, начислени дивиденди. Друг актив на дружеството е и сумата в размер на 545 лв. – авансово платена такса за КФН.

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

На 31.08.2006г. е изчислена нетна стойност на активите в размер на 5 734 710 лв. Към 29.09.2006г. нетната стойност на активите нараства до 6 218 743 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 5 757 710 лева.

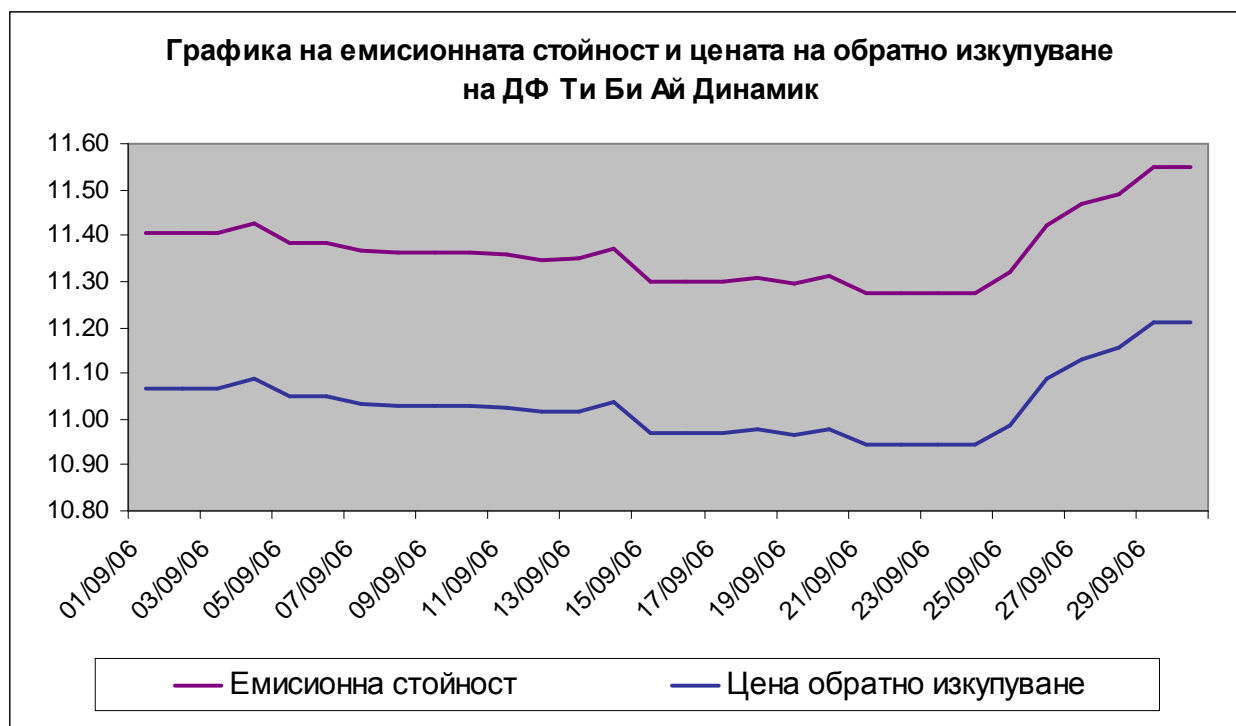
Средната годишна нетна стойност на активите е 3 958 856 лева.

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 01/09/2006 – 29/09/2006 е представена в таблицата и графиката и по-долу:

Дата	Емисионна стойност	Цена обратно изкупуване
02.10.2006	11.5497	11.2100
29.9.2006	11.4918	11.1538
28.9.2006	11.4683	11.1310
27.9.2006	11.4226	11.0866
26.9.2006	11.3202	10.9872
25.9.2006	11.2745	10.9429
21.9.2006	11.3105	10.9778
20.9.2006	11.2971	10.9648
19.9.2006	11.3097	10.9770

18.9.2006	11.3004	10.968
15.9.2006	11.3703	11.0359
14.9.2006	11.3518	11.0179
13.9.2006	11.3481	11.0143
12.9.2006	11.3575	11.0235
11.9.2006	11.3639	11.0297
08.9.2006	11.366	11.0317
07.9.2006	11.3861	11.0512
05.9.2006	11.4259	11.0899
04.9.2006	11.4041	11.0687
01.9.2006	11.3982	11.0630



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

През месец септември са записани 37 493.6035 дяла.

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

Дата	Операция	Брой дялове	Емисионна цена	Сума лв.
01/09/2006	записване	17.5466	11.3982	200.00
11/09/2006	записване	87.9980	11.3639	1 000.00
12/09/2006	записване	2 201.1886	11.3575	25 000.00

13/09/2006	записване	10.1339	11.3480	115.00
19/09/2006	записване	353.6787	11.3097	4 000.00
20/09/2006	записване	812.5979	11.2971	9 180.00
27/09/2006	записване	62.6013	11.4226	715.07
29/09/2006	записване	33 947.8585	11.4918	390 122.00
ОБЩО:		37 493.6035		430 332.07

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

През месец септември са изкупени обратно 1 479.4797 дяла.

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

Дата	Операция	Брой дялове	Цена на обратно изкупуване	Сума лв.
04/09/2006	обратно изкупуване	212.0000	11.0687	2 346.56
05/09/2006	обратно изкупуване	52.4209	11.0899	581.34
13/09/2006	обратно изкупуване	119.0000	11.0143	1 310.70
14/09/2006	обратно изкупуване	37.0000	11.0181	407.67
20/09/2006	обратно изкупуване	926.4955	10.9648	10 158.84
27/09/2006	обратно изкупуване	10.0000	11.0870	110.87
28/09/2006	обратно изкупуване	122.5633	11.1310	1 364.25
ОБЩО:		1 479.4797		16 280.23

В резултат на посочените по-горе записвания и обратни изкупувания, към 29.09.2006г. общият брой на дяловете на Фонда възлиза на 549 202.5259 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 изгъргувани ЦК	Обща стойност на сделките
13/09/2006	покупки	Холдинги	632	8 349
13/09/2006	продажби	Корпоративни облигации	225	450 799
14/09/2006	покупки	Телекомуникации, Туризм, Холдинги	1 633	25 207
15/09/2006	покупки	Лека промишленост, Холдинги	25 270	46 061
20/09/2006	покупки	Холдинги	100	1 675
20/09/2006	продажби	Холдинги	1 800	8 190
21/09/2006	покупки	Холдинги	190	2 695

25/09/2006	покупки	Холдинги	210	3 071
26/09/2006	покупки	Холдинги	50	667
27/09/2006	покупки	Холдинги	185	2 498
29/09/2006	покупки	Холдинги	125	2 143
29/09/2006	продажби	Телекомуникации, Фармацевтична промишленост	27 066	276 134
ОБЩО:			57 486	827 489

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