

---

**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 31.10.2006 г. акциите на български компании в портфейла на Фонда са разпределени в 10 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 31.10.2006г. възлиза на 57.41%.

Чуждестранните ценни книжа, които дават експозиция към доходността на акции на международни компании - сини чипове и компании от развиващите се пазари, представляват 12.63% от стойността на портфейла на Фонда.

Корпоративните облигации представляват 8.97% от стойността на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик. Ипотечните облигации представляват 1.55 % от стойността на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Банковите депозити съставляват 16.08% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.10.2006г. са 0.35% 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 2.20% от активите.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.10.2006г. е 13.51% на годишна база\*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е 28.01%.

**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 6 243 084 лева към 29.09.2006г. до 6 558 028 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		
	31.8.2006	29.9.2006	31.10.2006
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	736 007	952 769	1 263 398
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	185	324	331
Други разходи	4 165	5 212	6 287
Разходи за външни услуги	48 042	56 636	67 115
<b>Общо разходи</b>	<b>788 399</b>	<b>1 014 941</b>	<b>1 337 131</b>

Общият размер на разходите на фонда към 31.10.2006 г. е 1 337 131 лева, които включват 1 263 398 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 331 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 октомври 2006г. – 62 828 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.49 %

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

- към 31 октомври 2006г. – 3 844 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.09%

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 31 октомври 2006г. – 2 000 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 2006г. – 352 лв.

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

д) Други разходи

- към 31 октомври 2006г. – 4 378 лв.

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

- Други разходи по финансови операции: 2 443 лв.

- Външни услуги (КФН и БФБ): 1 935 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 73 402 лв. към месец октомври. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 1.745 %.

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

Долната таблица представя приходите на Фонда към 31.10.2006. Приходите са в размер на 1 895 лв, включващи приходи от операции с финансови активи, приходи от лихви и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лева		
	31.8.2006	29.9.2006	31.10.2006
Приходи от лихви	43 154	48 337	55 879
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	1 038 508	1 338 449	1 794 961
Други финансови приходи	44 367	44 367	44 367
<b>Общо приходи</b>	<b>1 126 029</b>	<b>1 431 153</b>	<b>1 895 207</b>

## II. Данни по чл. 18, ал. 2

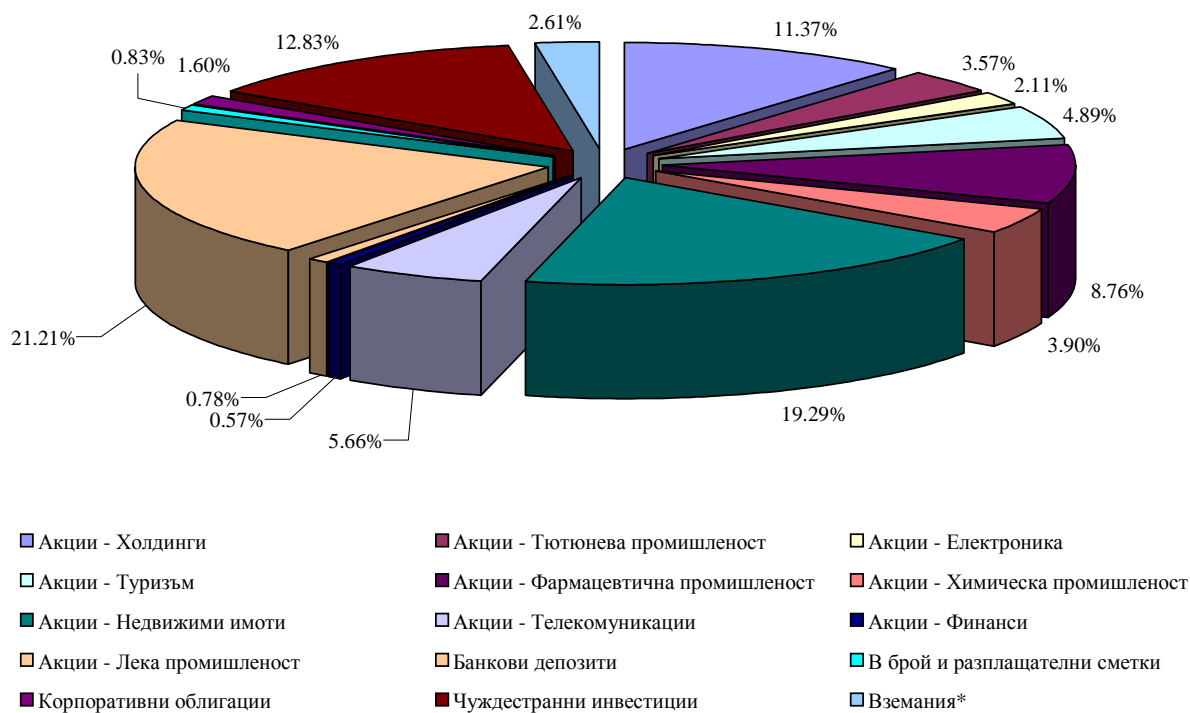
### 1) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла в началото и в края на отчетния период

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

<b>Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 29/09/2006</b>		
<b>Актив</b>	<b>Стойност в лева</b>	<b>Процент от активите</b>
<b>Акции - Холдинги</b>	<b>653 671</b>	<b>10.47%</b>
BG1100046983	337 541	5.41%
BG11BUSOGT 14	158	0.00%
BG1100005971	59 891	0.96%
BG1100019980	256 081	4.10%
<b>Акции - Тютюнева промишленост</b>	<b>369 083</b>	<b>5.91%</b>
BG11BLBLAT 13	76 404	1.22%
BG11SOSOVТ 14	292 679	4.69%
<b>Акции - Електроника</b>	<b>48 750</b>	<b>0.78%</b>
BG11ELPABT 16	48 750	0.78%
<b>Акции - Туризм</b>	<b>305 484</b>	<b>4.89%</b>
BG11ALBAAT 17	305 484	4.89%
<b>Акции - Фармацевтична промишленост</b>	<b>498 634</b>	<b>7.99%</b>
BG11BAKABT 17	393 512	6.30%
BG11SOSOBТ 18	105 122	1.68%
<b>Акции - Химическа промишленост</b>	<b>312 561</b>	<b>5.01%</b>
BG11ORRUAT 13	312 561	5.01%
<b>Акции и права - Недвижими имоти</b>	<b>1 225 848</b>	<b>19.64%</b>
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%
<b>Акции - Телекомуникации</b>	<b>353 065</b>	<b>5.66%</b>
BG1100005997	353 065	5.66%
<b>Акции - Финанси</b>	<b>35 663</b>	<b>0.57%</b>
BG1100098059	35 663	0.57%
<b>Банкови депозити</b>	<b>1 324 135</b>	<b>21.21%</b>
<b>В брой и разплащателни сметки</b>	<b>52 015</b>	<b>0.83%</b>
<b>Корпоративни облигации</b>	<b>100 194</b>	<b>1.60%</b>
BG2100027056	100 194	1.60%
<b>Чуждестранни инвестиции</b>	<b>800 772</b>	<b>12.83%</b>
DE000SG2J8T5	245 965	3.94%
XS0252187959	163 992	2.63%
XS0267513736	390 814	6.26%
<b>Вземания*</b>	<b>163 210</b>	<b>2.61%</b>
<b>Обща сума</b>	<b>6 243 084</b>	<b>100.00%</b>

\* 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 29/09/2006**

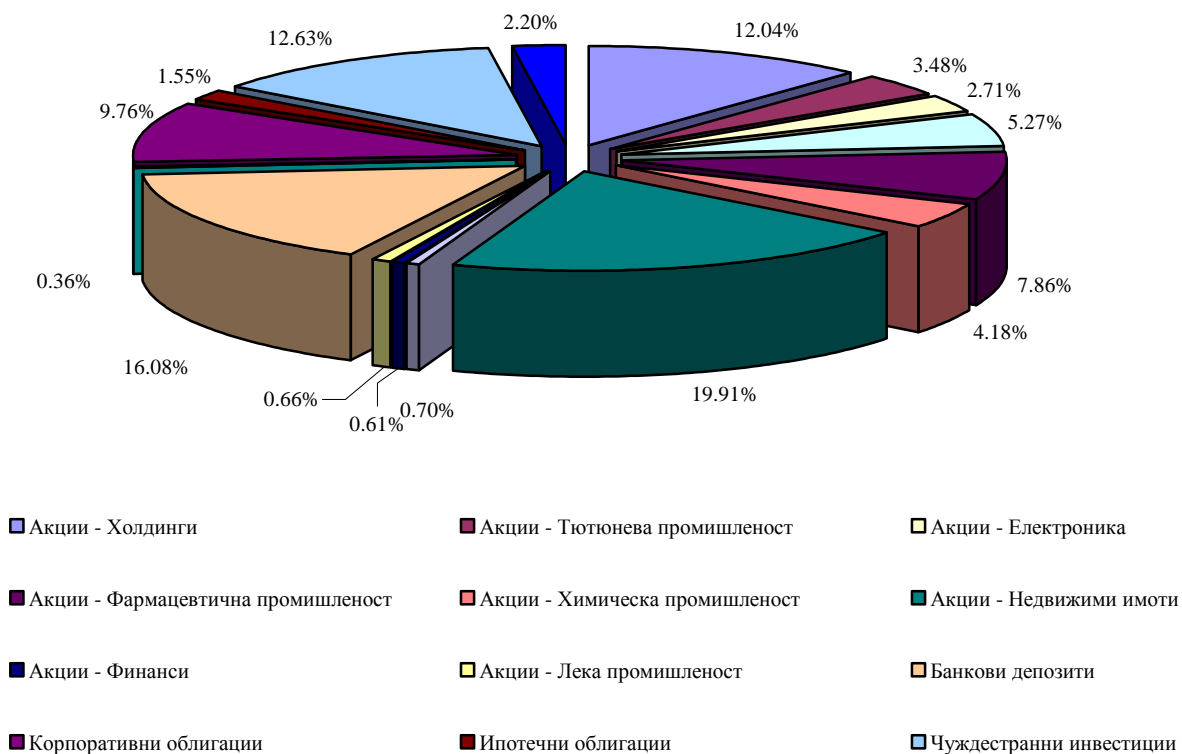


Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик в края на отчетния период е представена в следната таблица и графика.

<b>Структура на портфейла на ДФ Тн Би Ай Динамик към 31/10/2006</b>		
<b>Актив</b>	<b>Стойност в лева</b>	<b>Процент от активите</b>
<b>Акции - Холдинги</b>	<b>789 326</b>	<b>12.04%</b>
BG1100046983	347 803	5.30%
BG11BUSOGT14	164	0.00%
BG1100005971	101 746	1.55%
BG1100019980	339 614	5.18%
<b>Акции - Тютюнева промишленост</b>	<b>228 102</b>	<b>3.48%</b>
BG11BLBLAT13	82 187	1.25%
BG11SOSOV14	145 915	2.22%
<b>Акции - Електроника</b>	<b>177 901</b>	<b>2.71%</b>
BG11ELPAB16	177 901	2.71%
<b>Акции - Туризм</b>	<b>345 430</b>	<b>5.27%</b>
BG11ALBAAT17	345 430	5.27%
<b>Акции - Фармацевтична промишленост</b>	<b>515 489</b>	<b>7.86%</b>
BG11BAKAB17	386 369	5.89%
BG11SOSOB18	129 120	1.97%
<b>Акции - Химическа промишленост</b>	<b>273 866</b>	<b>4.18%</b>
BG11ORRUAT13	273 866	4.18%
<b>Акции - Лека промишленост</b>	<b>42 966</b>	<b>0.66%</b>
BG11DESLAT11	42 966	0.66%
<b>Акции и права - Недвижими имоти</b>	<b>1 305 827</b>	<b>19.91%</b>
BG1100003059	72 500	1.11%
BG1100025052	34 250	0.52%
BG1100030052	103 660	1.58%
BG1100042057	382 892	5.84%
BG1100109039	387 709	5.91%
РИИТ АДЦИЦ	150 000	2.29%
BG1100019055	24 816	0.38%
Health and Wellness АДЦИЦ	150 000	2.29%
<b>Акции - Телекомуникации</b>	<b>46 210</b>	<b>0.70%</b>
BG1100005997	46 210	0.70%
<b>Акции - Финанси</b>	<b>39 879</b>	<b>0.61%</b>
BG1100098059	39 879	0.61%
<b>Банкови депозити</b>	<b>1 054 741</b>	<b>16.08%</b>
<b>В брой и разплащателни сметки</b>	<b>23 819</b>	<b>0.36%</b>
<b>Корпоративни облигации</b>	<b>640 324</b>	<b>9.76%</b>
BG2100014054	51 830	0.79%
BG2100014062	172 799	2.63%
BG2100036057	50 857	0.78%
BG 2100007033	32 586	0.50%
BG2100022040	29 639	0.45%
BG2100030068	302 613	4.61%
<b>Ипотечни облигации</b>	<b>101 624</b>	<b>1.55%</b>
BG 2100020044	101 624	1.55%
<b>Чуждестранни инвестиции</b>	<b>828 005</b>	<b>12.63%</b>
DE000SG2J8T5	258 944	3.95%
XS0252187959	170 658	2.60%
XS0267513736	398 403	6.08%
<b>Вземания*</b>	<b>144 520</b>	<b>2.20%</b>
<b>Обща сума</b>	<b>6 558 028</b>	<b>100.00%</b>

\* Вземания във връзка с участие в 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 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. 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.

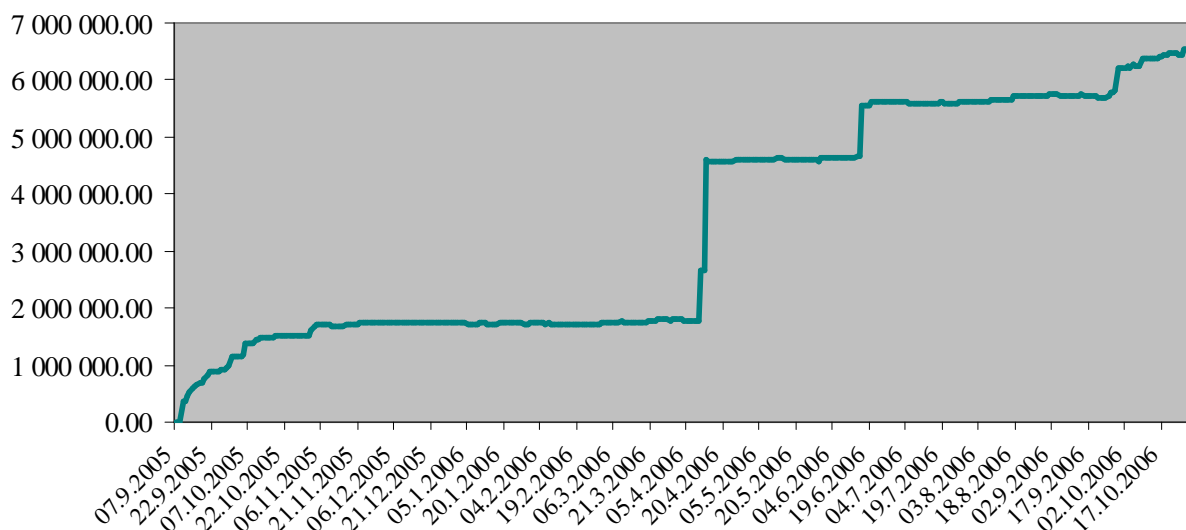
Към 31 октомври 2006г. други активи на Фонда представляват вземане във връзка с участието в увеличението на капитала на дружество, търгувано на БФБ-София АД, продажба на права, начислени дивиденди. Друг актив на дружеството е и сумата в размер на 359 лв. – авансово платена такса за КФН.

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

На 29.09.2006г. е изчислена нетна стойност на активите в размер на 6 218 743 лв. Към 31.10.2006г. нетната стойност на активите нараства до 6 542 136 лв.

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

### Нетна стойност на активите на Ти Би Ай Динамик



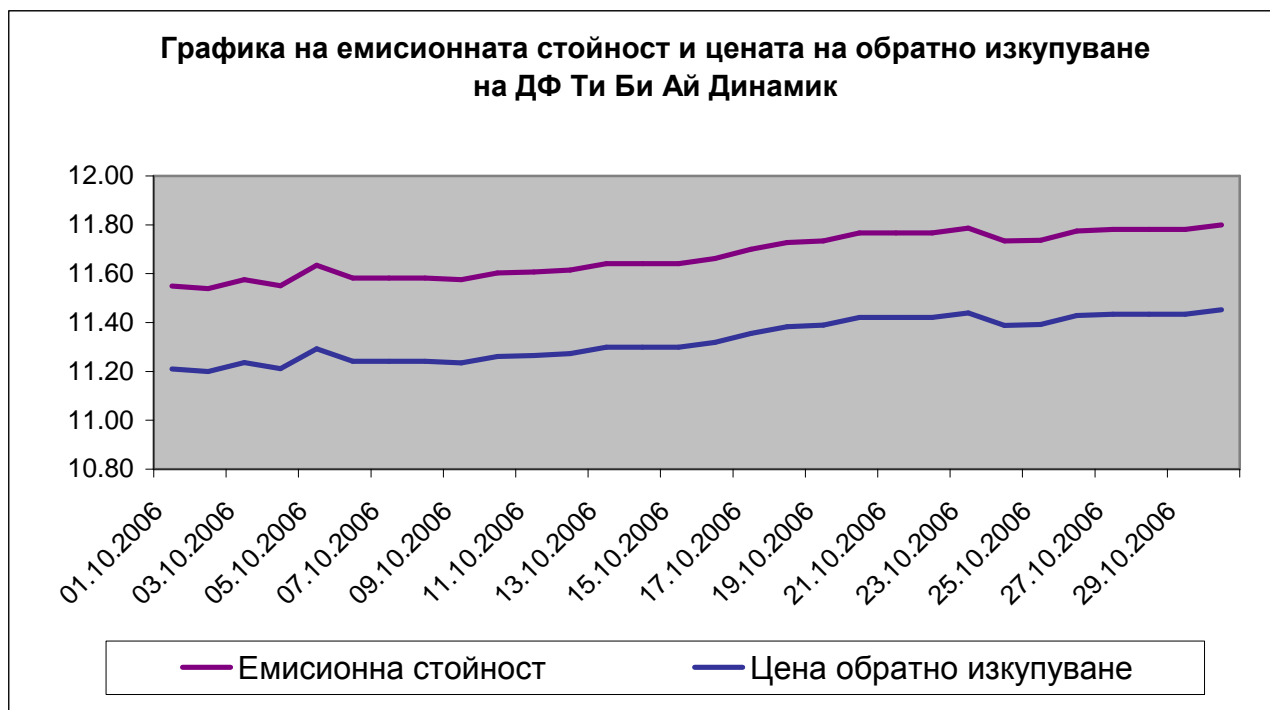
**4) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 3: Средна месечна и средна годишна нетна стойност на активите на Фонда**

Средната месечна нетна стойност на активите на Фонда е 6 393 869 лева.  
Средната годишна нетна стойност на активите е 4 207 163 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 01/10/2006 – 31/10/2006 е представена в таблицата и графиката и по-долу:

<b>Дата</b>	<b>Емисионна стойност</b>	<b>Цена обратно изкупуване</b>
01/10/2006	11.5497	11.2100
02/10/2006	11.5383	11.1990
03/10/2006	11.5761	11.2356
04/10/2006	11.5511	11.2114
05/10/2006	11.6342	11.2920
06/10/2006	11.5816	11.2410
07/10/2006	11.5816	11.2410
08/10/2006	11.5816	11.2410
09/10/2006	11.5760	11.2355
10/10/2006	11.6025	11.2613
11/10/2006	11.6070	11.2656
12/10/2006	11.6144	11.2728
13/10/2006	11.6411	11.2987
14/10/2006	11.6411	11.2987
15/10/2006	11.6411	11.2987
16/10/2006	11.6616	11.3186
17/10/2006	11.6994	11.3553
18/10/2006	11.7281	11.3831
19/10/2006	11.7340	11.3889
20/10/2006	11.7673	11.4212
21/10/2006	11.7673	11.4212
22/10/2006	11.7673	11.4212
23/10/2006	11.7865	11.4398
24/10/2006	11.7338	11.3887
25/10/2006	11.7370	11.3918
26/10/2006	11.7750	11.4287
27/10/2006	11.7811	11.4346
28/10/2006	11.7811	11.4346
29/10/2006	11.7811	11.4346
30/10/2006	11.7997	11.4526
31/10/2006	11.808	11.4607



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

През месец октомври са записани 20 940.5462 дяла.

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

Дата	Операция	Брой дялове	Емисионна стойност	Сума лв.
02.10.2006	записване	606.08	11.55	7 000.00
05.10.2006	записване	476.15	11.55	5 500.00
06.10.2006	записване	103.14	11.63	1 200.00
09.10.2006	записване	10 114.49	11.58	117 142.00
12.10.2006	записване	14.39	11.61	167.00
18.10.2006	записване	256.42	11.70	3 000.00
23.10.2006	записване	849.81	11.77	10 000.00
26.10.2006	записване	8 520.06	11.74	100 000.00

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

През месец октомври са изкупени обратно 5 023.1129 дяла.

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

Дата	Операция	Брой дялове	Цена на обратно изкупуване	Сума лв.
04.Октомври.06	обратно изкупуване	50.00	11.24	561.78
11.Октомври.06	обратно изкупуване	759.01	11.26	8 547.48
17.Октомври.06	обратно изкупуване	50.00	11.32	565.93
20.Октомври.06	обратно изкупуване	90.50	11.39	1 030.67
25.Октомври.06	обратно изкупуване	356.19	11.39	4 056.53
26.Октомври.06	обратно изкупуване	3 577.00	11.39	40 748.44
31.Октомври.06	обратно изкупуване	140.42	11.45	1 608.13

В резултат на посочените по-горе записвания и обратни изкупувания, към 31.10.2006г. общият брой на дяловете на Фонда възлиза на 565 119.9592 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 изгържувани ЦК	Обща стойност на сделките
02.Октомври.06	покупки	Недвижими имоти, Туризм, Фармацевтична промишленост	5060	34874.8
02.Октомври.06	продажби	Фармацевтична промишленост, Лека промишленост	3398	32888.04
03.Октомври.06	покупки	Фармацевтична промишленост	1226	7601.2
03.Октомври.06	продажби	Фармацевтична промишленост	2317	19657.53
04.Октомври.06	покупки	Корпоративни облигации	250	489348.67
05.Октомври.06	продажби	Лека промишленост	2240	4713.9
09.Октомври.06	покупки	Фармацевтична промишленост	6000	37200
10.Октомври.06	покупки	Холдинги, Туризм, Тютюнева промишленост	4366	26843
11.Октомври.06	продажби	Корпоративни облигации	150	302918.95
12.Октомври.06	покупки	Фармацевтична промишленост, Холдинги, Туризм, Тютюнева промишленост	4597	27695.25
12.Октомври.06	продажби	Фармацевтична промишленост	3710	21616
13.Октомври.06	покупки	Фармацевтична промишленост, Холдинги, Туризм, Тютюнева промишленост	2342	21402.5
13.Октомври.06	продажби	Фармацевтична промишленост	900	5220
16.Октомври.06	покупки	Недвижими имоти, Туризм	256	17965.8
18.Октомври.06	покупки	Холдинги	1534	26412.05

18.Октомври.06	продажби	Фармацевтична промишленост, Телекомуникации	3140	29272.6
19.Октомври.06	покупки	Холдинги, Фармацевтична промишленост, Туризм	1614	15692.66
20.Октомври.06	покупки	Корпоративни облигации, Ипотечни облигации, Фармацевтична промишленост, Холдинги, Туризм	3143	431506.29
23.Октомври.06	покупки	Недвижими имоти, Корпоративни облигации	35	29648.28
23.Октомври.06	продажби	Холдинги, Недвижими имоти	890	2548
24.Октомври.06	покупки	Недвижими имоти	5	7.25
24.Октомври.06	продажби	Фармацевтична промишленост	1552	9768.04
30.Октомври.06	покупки	Химическа промишленост	551	59574.55
30.Октомври.06	продажби	Корпоративни облигации, Ипотечни облигации	295	539160.45
31.Октомври.06	покупки	Химическа промишленост, Холдинги, Тютюнева промишленост, Туризм	245	10380.05

### 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