
**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 30.11.2006 г. акциите на български компании в портфейла на Фонда са разпределени в 12 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 30.11.2006г. възлиза на 58.29%.

Чуждестранните ценни книжа, които дават експозиция към доходността на акции на международни компании - сини чипове и компании от развиващите се пазари, представляват 12.02% от стойността на портфейла на Фонда.

Корпоративните облигации представляват 6.18% от стойността на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Банковите депозити съставляват 14.21% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.11.2006г. са 0.84% от стойността на портфейла.

Вземания във връзка със записването на акции от увеличението на капитала на две дружества, търгувани на БФБ-София АД, начислени дивиденди и авансово платена такса на КФН, представляват 8.46% от активите.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.11.2006г. е 15.30% на годишна база*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е 31.67%.

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 6 558 028 лева към 31.10.2006г. до 7 091 964 лева към 30.11.2006г.

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		
	29/09/2006	31/10/2006	30/11/2006
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	952 769	1 263 398	1 716 623
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	324	331	331
Други разходи	5 212	6 287	7 527
Разходи за външни услуги	56 636	67 115	77 399
Общо разходи	1 014 941	1 337 131	1 801 880

Общият размер на разходите на фонда към 30.11.2006 г. е 1 801 880 лева, които включват 1 716 623 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 30 ноември 2006г. – 72 697 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.64 %

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

- към 30 ноември 2006г. – 4 683 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.11%

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 30 ноември 2006г. – 2 200 лв.

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

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

- към 30 ноември 2006г. – 387 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.009%

д) Други разходи

- към 30 ноември 2006г. – 4 959 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.11%

- Други разходи по финансови операции: 2 843 лв.

- Външни услуги (КФН и БФБ): 2 116 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 84 926 лв. към месец ноември. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 1.92 %.

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

Долната таблица представя приходите на Фонда към 30.11.2006. Приходите са в размер на 2 559 623 лв, включващи приходи от операции с финансови активи, приходи от лихви и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лева		
	29.9.2006	31.10.2006	30.11.2006
Приходи от лихви	48 337	55 879	62 603
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	1 338 449	1 794 961	2 452 654
Други финансови приходи	44 367	44 367	44 367
Общо приходи	1 431 153	1 895 207	2 559 624

II. Данни по чл. 18, ал. 2

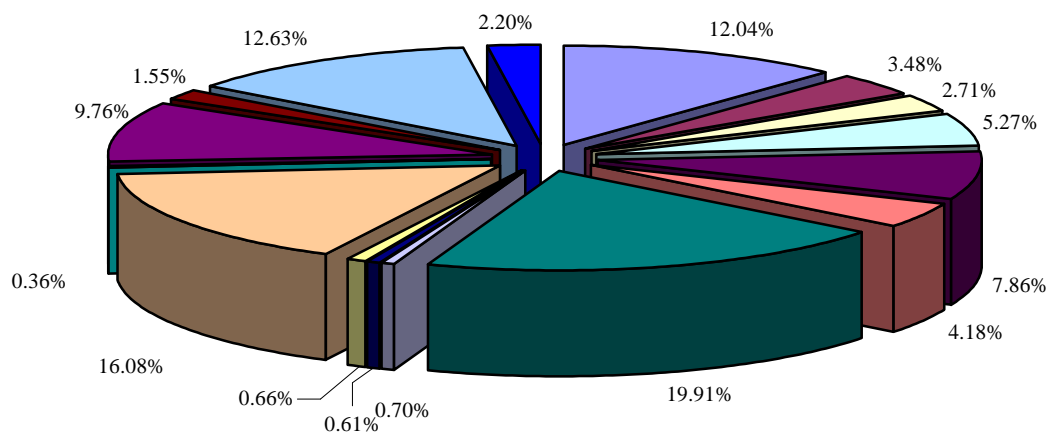
1) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла в началото и в края на отчетния период

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 31/10/2006		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	789 326	12.04%
Акции - Тютюнева промишленост	228 102	3.48%
Акции - Електроника	177 901	2.71%
Акции - Туризм	345 430	5.27%
Акции - Фармацевтична промишленост	515 489	7.86%
Акции - Химическа промишленост	273 866	4.18%
Акции - Недвижими имоти	1 305 827	19.91%
Акции - Телекомуникации	46 210	0.70%
Акции - Финанси	39 879	0.61%
Акции - Лека промишленост	42 966	0.66%
Банкови депозити	1 054 741	16.08%
В брой и разплащателни сметки	23 819	0.36%
Корпоративни облигации	640 324	9.76%
Ипотечни облигации	101 624	1.55%
Чуждестранни инвестиции	828 005	12.63%
Вземания*	144 520	2.20%
Обща сума	6 558 028	100.00%

* Вземания във връзка с 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



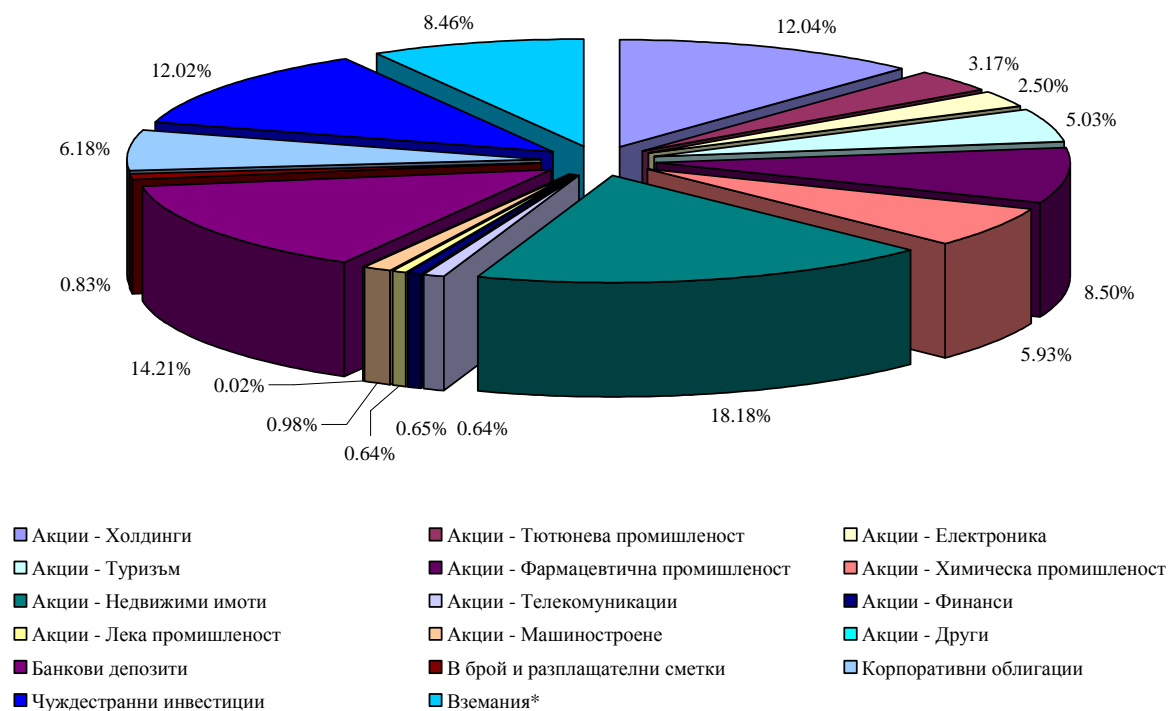
- | | | |
|--------------------------------------|----------------------------------|---------------------------|
| ■ Акции - Холдинги | ■ Акции - Тютюнева промишленост | □ Акции - Електроника |
| ■ Акции - Фармацевтична промишленост | ■ Акции - Химическа промишленост | ■ Акции - Недвижими имоти |
| ■ Акции - Финанси | ■ Акции - Лека промишленост | ■ Банкови депозити |
| ■ Корпоративни облигации | ■ Ипотечни облигации | ■ Чуждестранни инвестиции |

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 30/11/2006		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	853 958	12.04%
Акции - Тютюнева промишленост	224 588	3.17%
Акции - Електроника	177 653	2.50%
Акции - Туризм	356 449	5.03%
Акции - Фармацевтична промишленост	603 169	8.50%
Акции - Химическа промишленост	420 503	5.93%
Акции - Недвижими имоти	1 289 307	18.18%
Акции - Телекомуникации	45 704	0.64%
Акции - Финанси	46 213	0.65%
Акции - Лека промишленост	45 192	0.64%
Акции - Машиностроене	69 400	0.98%
Акции - Други	1 628	0.02%
Банкови депозити	1 007 989	14.21%
В брой и разплащателни сметки	59 123	0.83%
Корпоративни облигации	438 594	6.18%
Чуждестранни инвестиции	852 726	12.02%
Вземания*	599 769	8.46%
Обща сума	7 091 964	100.00%

* Вземания във връзка с участие в увеличението на капитала на две дружества и авансово платена такса на КФН.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 30/11/2006



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

Към 31 октомври 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 359 лв. – авансово платена такса за КФН.

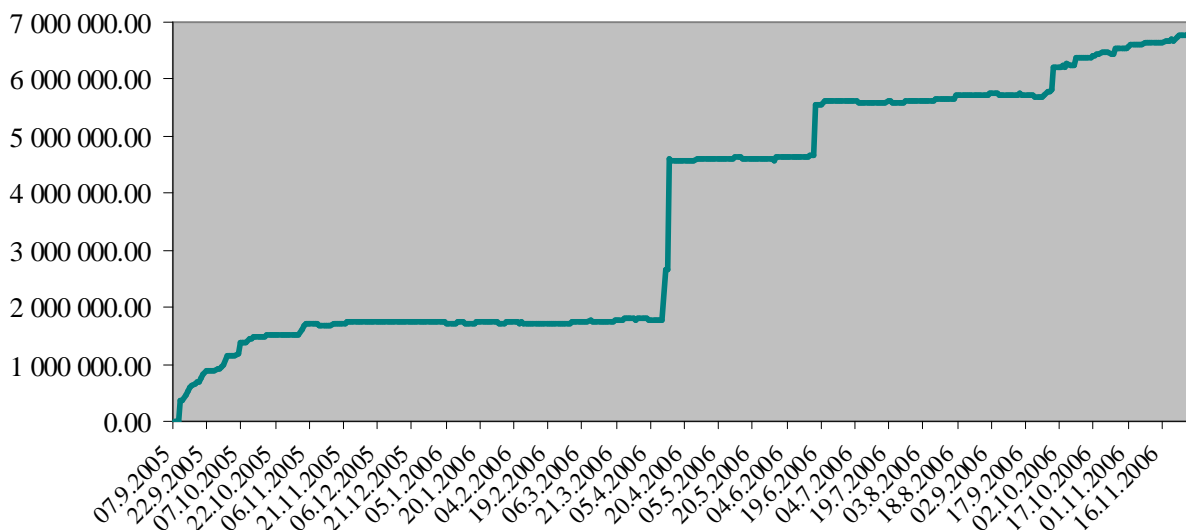
Към 30 ноември 2006г. други активи на Фонда представляват вземане във връзка с участието в увеличението на капитала на две дружества, търгувани на БФБ-София АД и начислени дивиденди. Друг актив на дружеството е сумата в размер на 130 лв. – авансово платена такса за КФН и сумата в размер на 48 лв.- авансово платена такса за БФБ.

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

На 31.10.2006г. е изчислена нетна стойност на активите в размер на 6 542 136 лв. Към 30.11.2006г. нетната стойност на активите нараства до 6 849 301 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

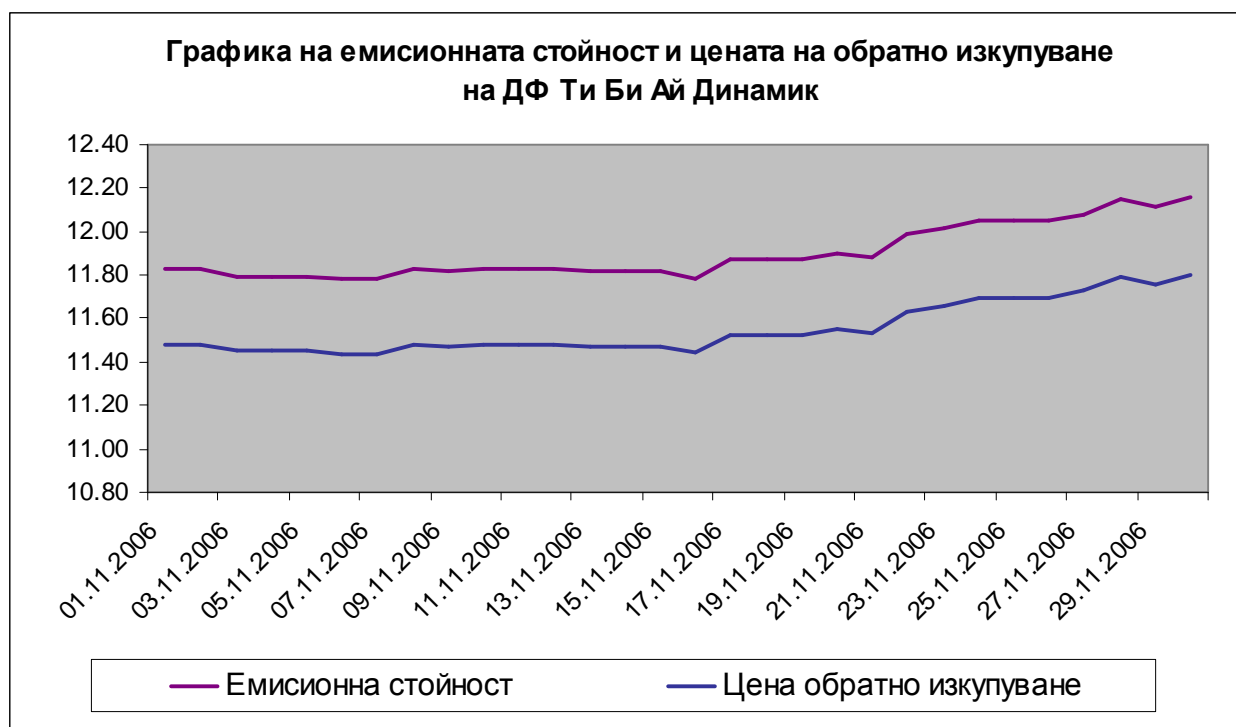
Средната месечна нетна стойност на активите на Фонда е 6 676 402 лева.

Средната годишна нетна стойност на активите е 4 429 353 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 01/11/2006 – 30/11/2006 е представена в таблицата и графиката и по-долу:

Дата	Емисионна стойност	Цена обратно изкупуване
01/11/2006	11.8262	11.4784
02/11/2006	11.8252	11.4774
03/11/2006	11.7965	11.4495
04/11/2006	11.7965	11.4495
05/11/2006	11.7965	11.4495
06/11/2006	11.7808	11.4343
07/11/2006	11.7817	11.4352
08/11/2006	11.8312	11.4832
09/11/2006	11.8165	11.4690
10/11/2006	11.8293	11.4814
11/11/2006	11.8293	11.4814
12/11/2006	11.8293	11.4814
13/11/2006	11.8172	11.4696
14/11/2006	11.8186	11.4710
15/11/2006	11.8199	11.4722
16/11/2006	11.7858	11.4392
17/11/2006	11.8718	11.5226
18/11/2006	11.8718	11.5226
19/11/2006	11.8718	11.5226
20/11/2006	11.9013	11.5512
21/11/2006	11.8826	11.5331
22/11/2006	11.9859	11.6334
23/11/2006	12.0157	11.6623
24/11/2006	12.0517	11.6972
25/11/2006	12.0517	11.6972
26/11/2006	12.0517	11.6972
27/11/2006	12.0826	11.7272
28/11/2006	12.1514	11.7940
29/11/2006	12.1164	11.7600
30/11/2006	12.1630	11.8053



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

През месец ноември са записани 9 654.5576 дяла.

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

дата	операция	брой дялове	емисионна стойност	сума лв.
01.11.2006	записване	3 048.81	11.81	36 000.31
02.11.2006	записване	1 691.16	11.83	20 000.00
03.11.2006	записване	422.83	11.83	5 000.00
06.11.2006	записване	707.84	11.80	8 350.00
08.11.2006	записване	848.77	11.78	10 000.00
10.11.2006	записване	456.99	11.82	5 400.00
15.11.2006	записване	169.22	11.82	2 000.00
16.11.2006	записване	1 373.97	11.82	16 240.20
17.11.2006	записване	254.54	11.79	3 000.00
23.11.2006	записване	20.02	11.99	240.00
27.11.2006	записване	248.93	12.05	3 000.00
29.11.2006	записване	411.48	12.15	5 000.00

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

През месец ноември са изкупени обратно 383.5349 дяла.

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

дата	операция	брой дялове	цена на обратно изкупуване	сума лв.
06.Ноември.06	обратно изкупуване	139.53	11.45	1 597.60
13.Ноември.06	обратно изкупуване	50.00	11.48	574.07
28.Ноември.06	обратно изкупуване	194.00	11.73	2 275.08

В резултат на посочените по-горе записвания и обратни изкупувания, към 30.11.2006г. общият брой на дяловете на Фонда възлиза на 574 390.9819 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 сделка	Сектор	Брой ЦК	Обща стойност
01.Ноември.06	покупки	химическа промишленост	158	17023.5
01.Ноември.06	продажби	тютюнева промишленост, електроника, холдинги	3485	27521
02.Ноември.06	покупки	химическа промишленост, холдинги	404	32700.5
02.Ноември.06	продажби	холдинги	120	2244
03.Ноември.06	покупки	химическа промишленост, холдинги, фармацевтична промишленост	6825	53546.9
03.Ноември.06	продажби	недвижими имоти, електроника, фармацевтична промишленост, холдинги	5638	35609.65
06.Ноември.06	покупки	холдинги, фармацевтична промишленост	130	2137.35
06.Ноември.06	продажби	холдинги, недвижими имоти	338	2825.44
07.Ноември.06	продажби	фармацевтична промишленост, електроника	4225	31042.32
08.Ноември.06	покупки	холдинги, фармацевтична промишленост	5330	35681
08.Ноември.06	продажби	електроника, холдинги	20035	98361.25
09.Ноември.06	покупки	тютюнева промишленост, фармацевтична промишленост, недвижими имоти, холдинги, туризъм, корпоративни облигации	1643	218949.76
09.Ноември.06	продажби	електроника	120	2556

10.Ноември.06	покупки	недвижими имоти, холдинги	509	9367
10.Ноември.06	продажби	електроника, фармацевтична промишленост, холдинги	4824	33105.6
13.Ноември.06	покупки	тютюнева промишленост, недвижими имоти	509	1011.15
13.Ноември.06	продажби	електроника	120	2645
14.Ноември.06	покупки	фармацевтична промишленост, недвижими имоти, тютюнева промишленост, химическа промишленост, туризъм, машиностроене, холдинги	15732	114386.16
14.Ноември.06	продажби	холдинги	7500	39750
15.Ноември.06	покупки	недвижими имоти, химическа промишленост, холдинги, тютюнева промишленост	2472	24039.3
16.Ноември.06	покупки	недвижими имоти, химическа промишленост, холдинги, тютюнева промишленост	328	7306.6
17.Ноември.06	покупки	тютюнева промишленост, електроника	33537	235646.15
17.Ноември.06	продажби	електроника	430	10884
20.Ноември.06	покупки	тютюнева промишленост, недвижими имоти, други	100070	99271
20.Ноември.06	продажби	фармацевтична промишленост	7838	52514.6
21.Ноември.06	покупки	тютюнева промишленост, недвижими имоти	7	147.45
22.Ноември.06	покупки	тютюнева промишленост, недвижими имоти, холдинги, други	2825	7024.1
22.Ноември.06	продажби	холдинги	955	12892.5
23.Ноември.06	покупки	тютюнева промишленост, туризъм, холдинги,	1883	31007.96
23.Ноември.06	продажби	туризъм	24	1877.28
24.Ноември.06	покупки	химическа промишленост, фармацевтична промишленост, туризъм, тютюнева промишленост, холдинги, корпоративни облигации	350	41505.5
24.Ноември.06	продажби	холдинги	141	1952.85
27.Ноември.06	покупки	холдинги	999	13912.85
28.Ноември.06	покупки	фармацевтична промишленост, холдинги, туризъм	1565	15071.25
29.Ноември.06	покупки	недвижими имоти, холдинги	651	9264.55
30.Ноември.06	продажби	корпоративни облигации	30	31375.8

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