

ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО ЧЛ. 53, АЛ. 3 ОТ ПРАВИЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „ТИ БИ АЙ ДИНАМИК”

І. Данни по чл. 53, ал. 3

1) Данни по чл. 53, ал. 3 т. 3: 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 13 български публични дружества, търгувани на БФБ – София АД. Към 28.02.2006 г. акциите в портфейла на Фонда са разпределени в 6 сектора.

Общият дял на акциите в портфейла към 28.02.2006г. възлиза на 65.70%.

Корпоративните облигации представляват 11.08 % от стойността на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Съгласно ограниченията, свързани с ликвидността на Фонда, паричните средства на каса, по разплащателни сметки и банковите депозити са в размер на 18.39% от стойността на портфейла. Само паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 28.02.2006г. са 3.46% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка със записването на акции от увеличението на капитала на дружество от портфейла на Фонда представляват 4.83% от активите.

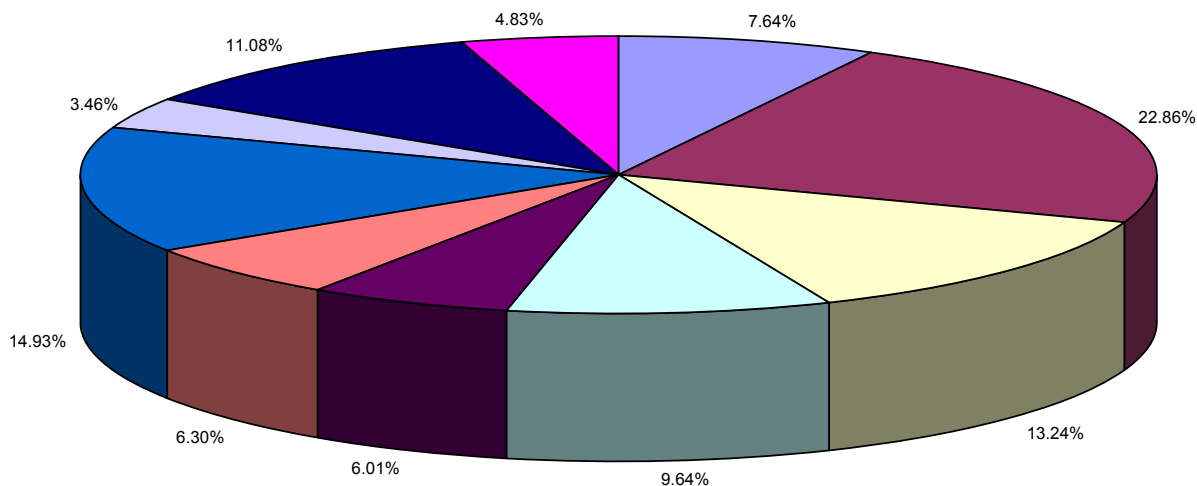
Към 28.12.2006 г. общата стойност на портфейла на Фонда нараства до 1 781 646 лева.

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

| Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 28/02/2006 | | |
|--|-----------------|---------------------|
| Актив | Стойност в лева | Процент от активите |
| Акции -Тежка промишленост | 136 177 | 7.64% |
| Акции - Холдинги | 407 259 | 22.86% |
| Акции - Гютюнева промишленост | 235 954 | 13.24% |
| Акции- Електроника | 171 755 | 9.64% |
| Акции- Туризм | 107 076 | 6.01% |
| Акции - Фармацевтична промишленост | 112 301 | 6.30% |
| Банкови депозити | 266 014 | 14.93% |
| В брой и разплащателни сметки | 61 643 | 3.46% |
| Корпоративни облигации | 197 375 | 11.08% |
| Вземания * | 86 091 | 4.83% |
| Обща сума | 1 781 646 | 100.00% |

* Вземане във връзка със записването на акции от увеличението на капитала на дружество, търгувано на БФБ - София и авансово платена такса за поддържане на емисия на БФБ – София АД

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 28/02/2006



| | |
|-------------------------------|------------------------------------|
| Акции - Тежка промишленост | Акции - Холдинги |
| Акции - Тютюнева промишленост | Акции - Електроника |
| Акции - Туризм | Акции - Фармацевтична промишленост |
| Банкови депозити | В брой и разплащателни сметки |
| Корпоративни облигации | Вземания * |

2) Данни по чл. 53, ал. 3 т. 4: Стойност на портфейла в началото и в края на отчетния период

През отчетния период стойността на портфейла на Фонда нараства от 1 735 306 лева към 31.01.2006г. до 1 781 646 лева към 28.02.2006г.

3) Данни по чл. 53, ал. 3 т. 5: 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. | | |
|--|----------------|---------------|---------------|
| | 30/12/2005 | 31/01/2006 | 28/02/2006 |
| Разходи от операции с финансови активи и инструменти | 150 763 | 52 732 | 71 044 |
| Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове | | | 14 |
| Други разходи | 2 003 | 193 | 1 011 |
| Разходи за външни услуги | 8 988 | 2 954 | 5 728 |
| Общо разходи: | 161 754 | 55 879 | 77 797 |

Общият размер на разходите на фонда към 28.02.2006 г. е 77 797 лева, които включват 71 044 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 14 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 28 февруари 2006 – 5016 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.29%

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

- към 28 февруари 2006 – 807 лв.

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

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 28 февруари 2006 – 400 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.02%

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

- към 28 февруари 2006 – 68 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.004%

д) Други разходи

- към 28 февруари 2006 – 448 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.026%

- Други разходи по финансови операции: 204 лв.

- Външни услуги (КФН и БФБ): 244 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 6 739 лв. към месец февруари. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 0.39 %.

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

Долната таблица представя приходите на Фонда към 28.02.2006. Приходите са в размер на 136 750 лв, включващи преценка от операции с финансови активи и приходи от лихви.

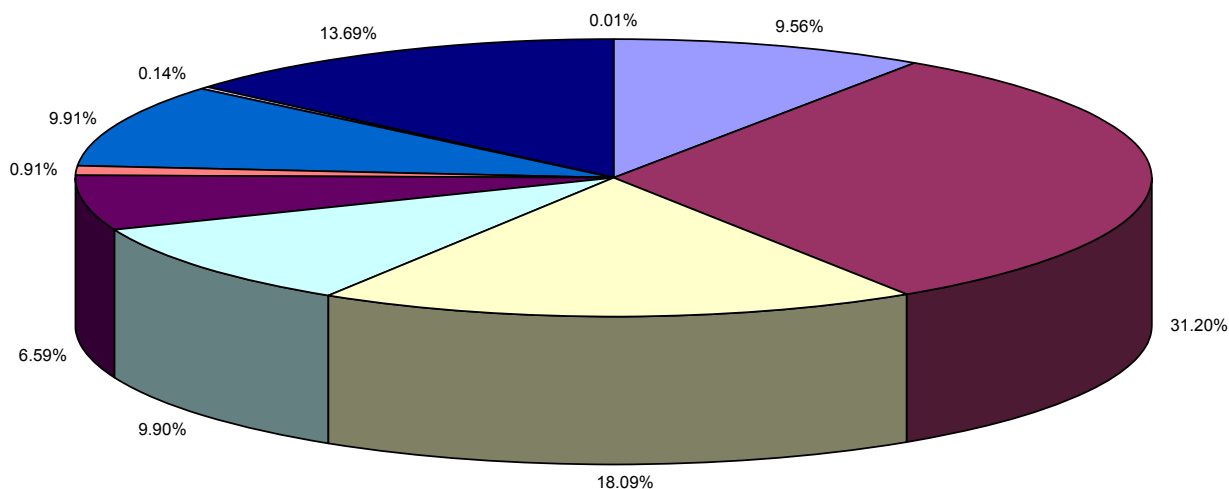
| Приходи | Стойност в лв. | | |
|--|----------------|---------------|----------------|
| | 30/12/2005 | 31/01/2006 | 28/02/2006 |
| Приходи от лихви | 2 156 | 2 035 | 3 630 |
| Приходи от операции с финансови активи и инструменти | 158 768 | 77 866 | 133 120 |
| Общо приходи: | 160 924 | 79 901 | 136 750 |

5) Данни по чл. 53, ал. 3 т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла на Фонда в началото 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 31/01/2006 | | |
|--|-----------------|---------------------|
| Актив | Стойност в лева | Процент от активите |
| Акции -Тежка промишленост | 165 913 | 9.56% |
| Акции - Холдинги | 541 433 | 31.20% |
| Акции - Тютюнева промишленост | 313 979 | 18.09% |
| Акции- Електроника | 171 755 | 9.90% |
| Акции- Туризм | 114 364 | 6.59% |
| Акции - Фармацевтична промишленост | 15 820 | 0.91% |
| Банкови депозити | 172 018 | 9.91% |
| В брой и разплащателни сметки | 2 424 | 0.14% |
| Корпоративни облигации | 237 489 | 13.69% |
| Вземания | 114 | 0.01% |
| Обща сума | 1 735 306 | 100.00% |

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/01/2006



| | |
|-------------------------------|------------------------------------|
| Акции - Тежка промишленост | Акции - Холдинги |
| Акции - Тютюнева промишленост | Акции - Електроника |
| Акции - Туризм | Акции - Фармацевтична промишленост |
| Банкови депозити | В брой и разплащателни сметки |
| Корпоративни облигации | Вземания |

б) Данни по чл. 53, ал. 3 т. 2: 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 |
|------------|------------|--|-------------------------|---------------------------|
| 01/02/2006 | покупки | Фармацевтична промишленост | 7 000 | 56 000 |
| 03/02/2006 | продажби | Холдинги | 13 205 | 174 320 |
| 08/02/2006 | покупки | Туризм, Недвижими имоти | 28 470 | 30 454 |
| 08/02/2006 | продажби | Туризм | 70 | 1 862 |
| 13/02/2006 | покупки | Холдинги, Тютюнева промишленост | 110 | 2 843 |
| 14/02/2006 | покупки | Холдинги | 250 | 988 |
| 15/02/2006 | покупки | Фармацевтична промишленост | 14 000 | 88 200 |
| 15/02/2006 | продажби | Корпоративни облигации | 26 | 35 257 |
| 23/02/2006 | покупки | Фармацевтична промишленост | 700 | 5 964 |
| 23/02/2006 | продажби | Тежка промишленост, Холдинги, Фармацевтична промишленост | 8 536 | 56 072 |

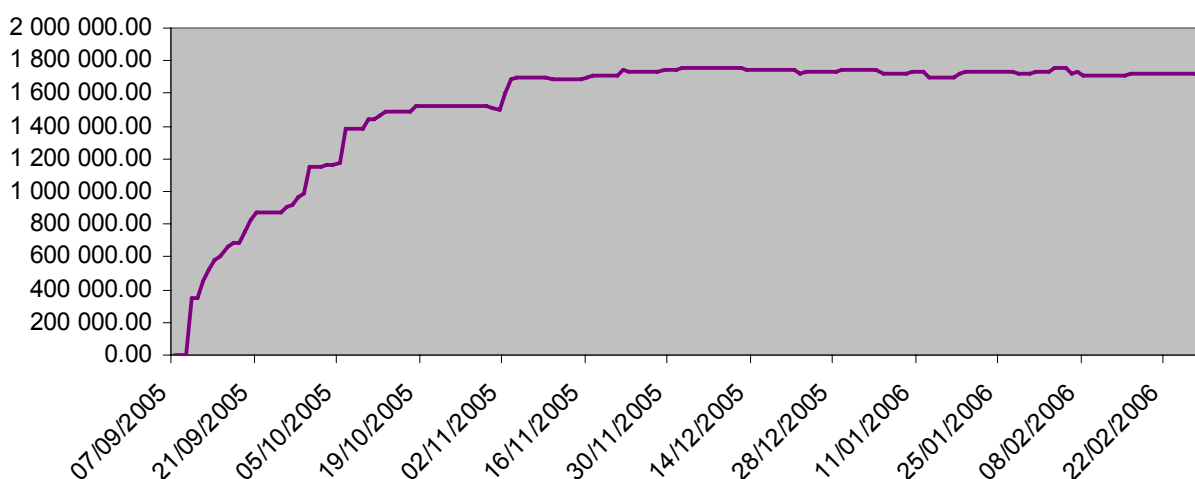
| | | | | |
|--------------|----------|----------------------------|----------------|----------------|
| 24/02/2006 | покупки | Холдинги | 1 024 | 14 976 |
| 24/02/2006 | продажби | Фармацевтична промишленост | 6 873 | 53 073 |
| 27/02/2006 | покупки | Недвижими имоти | 24 074 | 39 000 |
| 28/02/2006 | продажби | Недвижими имоти | 4 011 | 8 022 |
| ОБЩО: | | | 108 349 | 567 030 |

7) Данни по чл. 53, ал. 3 т. 6: Нетна стойност на активите на Фонда в началото и в края на отчетния период

На 31 януари 2006 г. е изчислена нетна стойност на активите в размер на 1 734 610 лв. Към 28 февруари 2006 нетната стойност на активите е 1 719 851 лв.

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

Нетна стойност на активите на Ти Би Ай Динамик



8) Данни по чл. 53, ал. 3 т. 7: Средна месечна и средна годишна нетна стойност на активите на Фонда

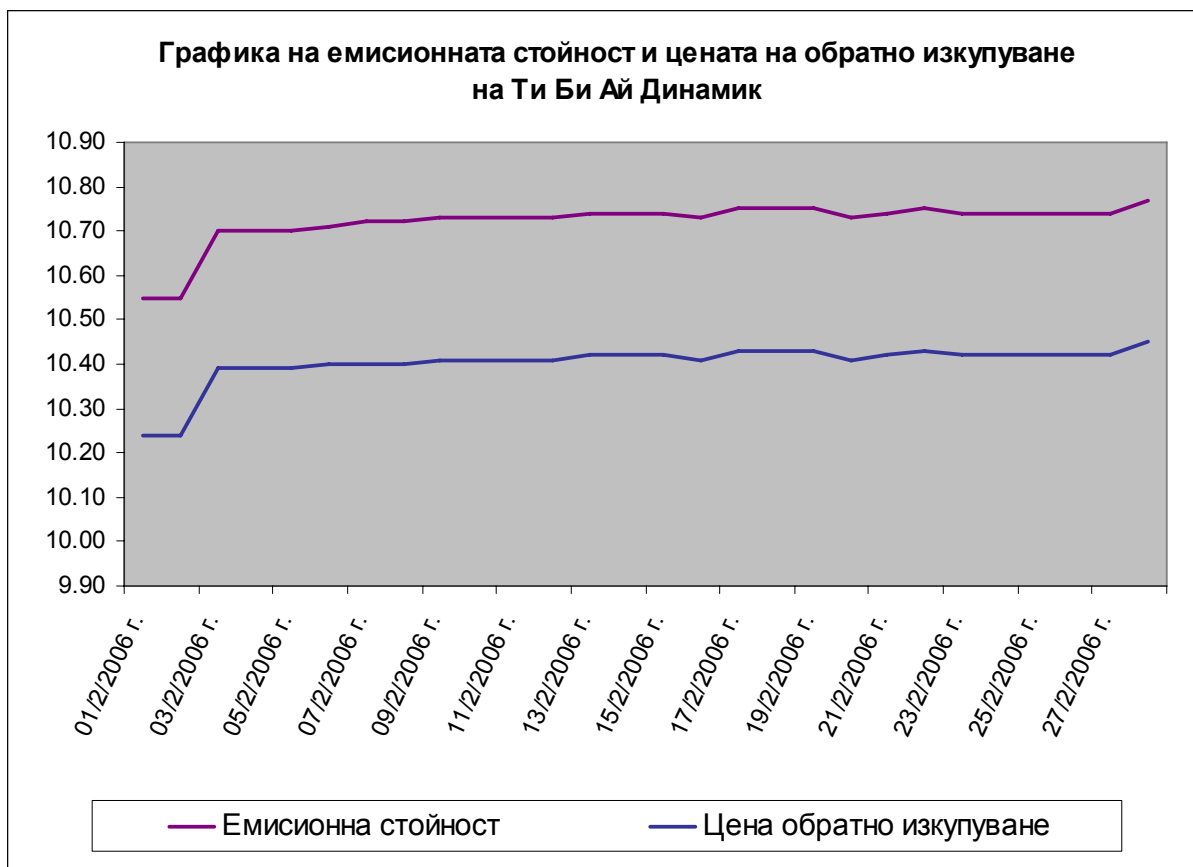
Средната месечна нетна стойност на активите на Фонда е 1 720 072 лева.

Средната годишна нетна стойност на активите е 1 722 867 лева.

9) Данни по чл. 53, ал. 3 т. 8: 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 01/02/2006 – 28/02/2006 е представена в таблицата и графиката и по-долу:

| Дата | Емисионна стойност | Цена обратно изкупуване |
|------------|--------------------|-------------------------|
| 01/03/2006 | 10.77 | 10.45 |
| 28/02/2006 | 10.74 | 10.42 |
| 27/02/2006 | 10.74 | 10.42 |
| 24/02/2006 | 10.74 | 10.42 |
| 23/02/2006 | 10.75 | 10.43 |
| 22/02/2006 | 10.74 | 10.42 |
| 21/02/2006 | 10.73 | 10.41 |
| 20/02/2006 | 10.75 | 10.43 |
| 17/02/2006 | 10.73 | 10.41 |
| 16/02/2006 | 10.74 | 10.42 |
| 15/02/2006 | 10.74 | 10.42 |
| 14/02/2006 | 10.74 | 10.42 |
| 13/02/2006 | 10.73 | 10.41 |
| 10/02/2006 | 10.73 | 10.41 |
| 09/02/2006 | 10.72 | 10.40 |
| 08/02/2006 | 10.72 | 10.40 |
| 07/02/2006 | 10.71 | 10.40 |
| 06/02/2006 | 10.70 | 10.39 |
| 03/02/2006 | 10.55 | 10.24 |
| 02/02/2006 | 10.55 | 10.24 |
| 01/02/2006 | 10.56 | 10.25 |



10) Данни по чл. 53, ал. 3 т. 9: Брой и цени на издадените (продадените) дялове

През месец февруари са записани 2 831.0739 дяла.

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

| Дата | Операция | Брой дялове | Емисионна цена | Сума лв. |
|--------------|-----------|-------------------|----------------|---------------|
| 03/02/2006 | записване | 920.7583 | 10.55 | 9 714 |
| 07/02/2006 | записване | 280.1120 | 10.71 | 3 000 |
| 10/02/2006 | записване | 279.5899 | 10.73 | 3 000 |
| 13/02/2006 | записване | 559.1798 | 10.73 | 6 000 |
| 14/02/2006 | записване | 186.2198 | 10.74 | 2 000 |
| 16/02/2006 | записване | 186.2197 | 10.74 | 2 000 |
| 22/02/2006 | записване | 325.8845 | 10.74 | 3 500 |
| 24/02/2006 | записване | 93.1099 | 10.74 | 1 000 |
| ОБЩО: | | 2 831.0739 | | 30 214 |

11) Данни по чл. 53, ал. 3 т. 10: Брой и цени на изкупените обратно дялове

През месец февруари са изкупени обратно 7 616 дяла.

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

| Дата | Операция | Брой дялове | Цена на обратно изкупуване | Сума лв. |
|--------------|--------------------|------------------|----------------------------|---------------|
| 03/02/2006 | обратно изкупуване | 4408.0000 | 10.24 | 45 138 |
| 08/02/2006 | обратно изкупуване | 2400.0000 | 10.40 | 24 960 |
| 10/02/2006 | обратно изкупуване | 244.0000 | 10.41 | 2 540 |
| 24/02/2006 | обратно изкупуване | 564.0000 | 10.42 | 5 877 |
| ОБЩО: | | 7616.0000 | | 78 515 |

В резултат на посочените по-горе записвания и обратни изкупувания, към 28.02.2006г. общият брой на дяловете на Фонда възлиза на 162 883.3514 дяла.

12) Данни по чл. 53, ал. 3 т. 11: Финансово състояние на другите активи на Фонда в началото и края на периода

Към 28 февруари 2006г. други активи на Фонда представляват вземане, свързано със записване на акции от увеличение на капитала на дружество, търгувано на БФБ – София .

Към 28.02.2006 г. друг актив на дружеството е и сумата в размер на 550 лв. – авансово платена такса за поддържане на емисия на БФБ – София АД.

II. Данни по чл. 53, ал. 4

Обобщена информация за отчетния период е представена в сравнителна таблица (виж *Приложение I*).