
**ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО
ЧЛ. 73Г ОТ НАРЕДБА № 25 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА
ИНВЕСТИЦИОННИТЕ ДРУЖЕСТВА И ДОГОВОРНИ ФОНДОВЕ ЗА ДОГОВОРЕН
ФОНД „ТИ БИ АЙ ДИНАМИК”**

Данни по чл. 73г, ал. 1, т. 6 от Наредба № 25

1) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б „г”: Промени в структурата на портфейла през отчетния период

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, както и на чуждестранни инвестиции.

Към 31.12.2009г. акциите на български компании в портфейла на Фонда са разпределени в 11 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 31.12.2009г. възлиза на 67,65%.

Корпоративните облигации в портфейла представляват 1,38% от активите на Ти Би Ай Динамик. Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 31.12.2009г. възлизат на 15,31% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 15,15% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.12.2009г. са 0,41% от стойността на портфейла.

Вземанията от дивиденди и от продажба на права възлизат на 0,11% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.12.2009г. е минус 3,42% на годишна база*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 14,38%. А доходността на Фонда от началото на тази година до 31.12.2009г. е 2,87%.

2) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „а” и „д”: Промени в състоянието на активите в рамките на отчетния период

Долната таблица представя приходите на Фонда към 31.12.2009г. Приходите са в размер на 6 008 271 лв, включващи приходи от операции с финансови активи, приходи от лихви и други финансови приходи.

* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

Приходи	Стойност в лева		
	30.6.2009	30.9.2009	31.12.2009
Приходи от лихви	17 008	28 992	38 998
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	3 443 724	4 940 634	5 806 841
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	14	19	51 740
Други финансови приходи	46 959	110 692	110 692
Общо приходи	3 507 705	5 080 337	6 008 271

Разходите на Фонда за отчетния период са представени в таблицата по-долу:

Разходи	Стойност в лева		
	30.6.2009	30.9.2009	31.12.2009
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	3 827 871	4 920 290	5 931 860
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	90	275	52 937
Други разходи	4 060	7 484	13 313
Разходи за външни услуги	30 517	46 447	62 963
Общо разходи	3 862 538	4 974 496	6 061 073

Общият размер на разходите на фонда към 31.12.2009г. е 6 061 073 лева, които включват 5 931 860 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти, 52 937 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 31 декември 2009г. – 56 502 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1,8011 %

б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява

инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество

- към 31 декември 2009г. – 10 493 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.3345%

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 31 декември 2009г. – 2 889 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.0921%

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

- към 31 декември 2009г. – 2 400 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.0765%

д) Други разходи

- към 31 декември 2009г. – 3 992 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.1273%

- Други разходи по финансови операции: 2 820 лв.
- Външни услуги (КФН, БФБ и ЦД): 1 172 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 76 276 лв. към месец декември. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 2,4314 %.

За периода са записани 1 741,3075 дяла и са обратно изкупени 21 419,3020 дяла. НСА на фонда към 30.09.2009г. е 3 510 011,17 лв., а към 31.12.2009г. е 3 180 897,59 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 368 891,9300.

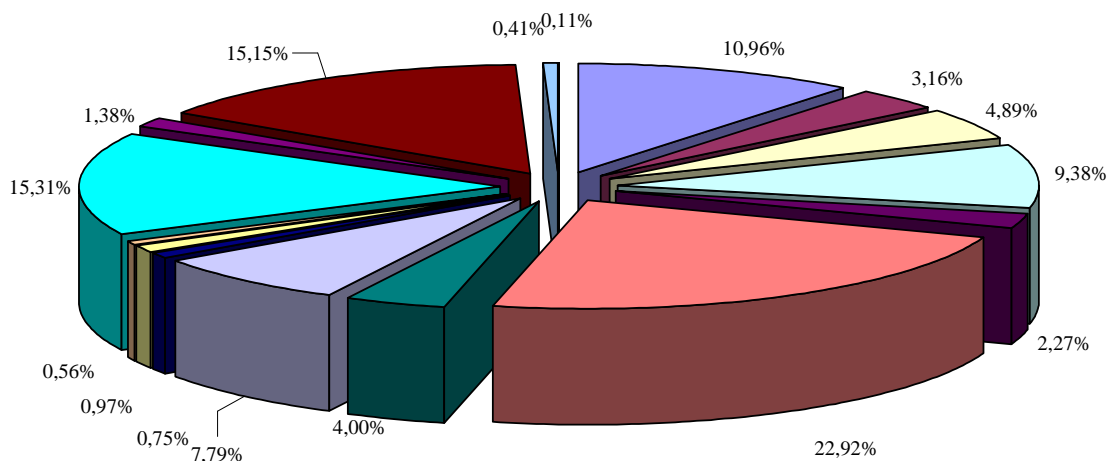
3) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „в”: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

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

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 30/12/2009		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	349 931	10,96%
Акции - Тютюнева промишленост	100 847	3,16%
Акции - Туризм	156 037	4,89%
Акции - Фармацевтична промишленост	299 460	9,38%
Акции - Енергетика	72 491	2,27%
Акции - Недвижими имоти	732 106	22,92%
Акции - Лека промишленост	127 715	4,00%
Акции - Тежка промишленост	248 890	7,79%
Акции - Хранително-вкусова промишленост	23 871	0,75%
Акции - Услуги	30 989	0,97%
Акции - Финанси	17 897	0,56%
Чуждестранни инвестиции	488 776	15,31%
Облигации	44 016	1,38%
Банкови депозити	483 781	15,15%
В брой и разплащателни сметки	13 121	0,41%
Вземания*	3 558	0,11%
Обща сума	3 193 487	100,00%

* Вземания от дивиденди и от продажба на права

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/12/2009

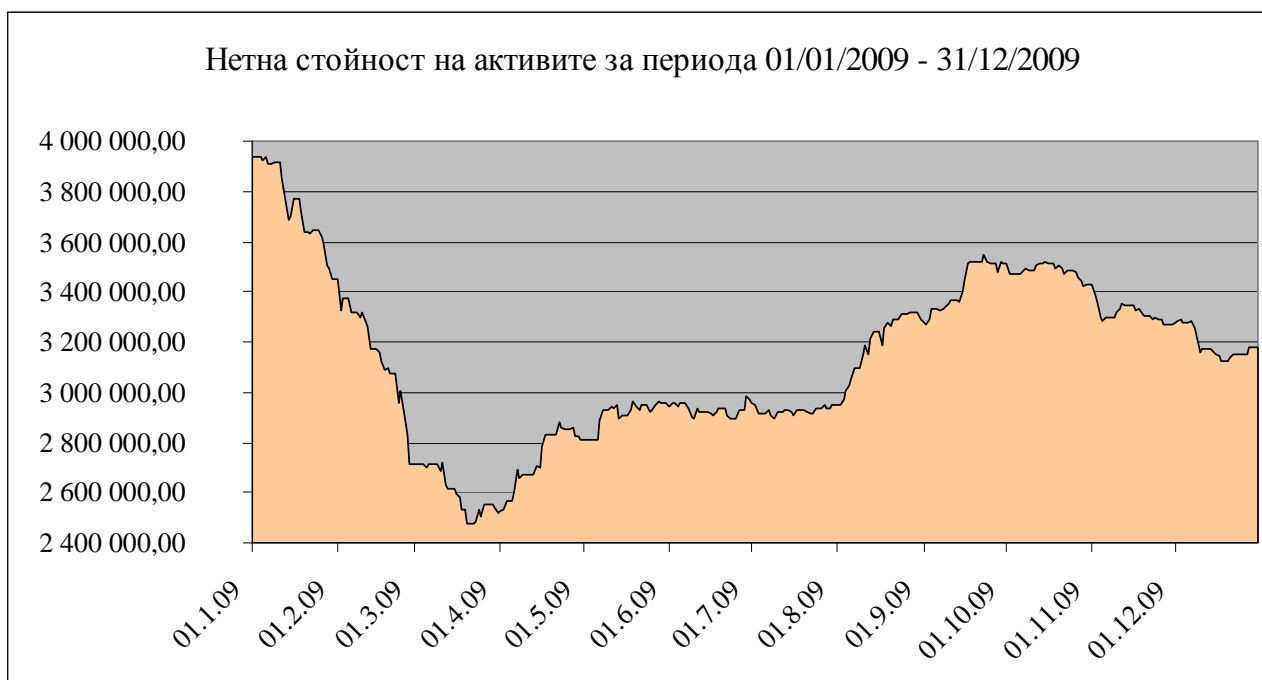


- Акции - Холдинги
- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Лека промишленост
- Акции - Услуги
- Облигации
- Вземания*
- Акции - Тютюнева промишленост
- Акции - Енергетика
- Акции - Тежка промишленост
- Акции - Финанси
- Банкови депозити
- Акции - Туризм
- Акции - Недвижими имоти
- Акции - Хранително-вкусова промишленост
- Чуждестранни инвестиции
- В брой и разплащателни сметки

4) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „б“: Нетна стойност на активите на един дял

На 30.09.2009 г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 9,0332 лв. Към 31.12.2009 г. нетната стойност на активите на един дял е 8,6228 лв.

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



5) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „е“: Сравнителна таблица за последните три финансови години, включваща общата стойност на нетните активи и нетна стойност на един дял

	Към 31 Декември 2007	Към 31 Декември 2008	Към 31 Декември 2009
Нетна стойност на активите	7 232 594	3 938 566	3 180 898
Нетна стойност на активите на един дял	12,3061	8,3826	8,6228

6) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „ж“: Задължения, възникнали от сделки с деривативни инструменти по чл. 195, ал. 1, т. 7 от ЗППЦК

Във връзка с притежаваните от Фонда валутно деноминирани активи, управляващото дружество извършва хеджиращи сделки с цел предпазване от валутния риск, на който е изложен Фонда. Хеджираните активи и сключените сделки към 31.12.2009г. са описани по-долу.

Рисков актив				
ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
US25459W5168	USD	930,000	75,0278	\$69 775,85
LU0066757435	USD	3 446,523	23,6996	\$81 681,22
Обща рискова позиция				\$151 457,07

Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 110 000,00	1,47060	\$161 766,00	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$161 766,00		

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД