
**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 28.02.2007 г. акциите на български компании в портфейла на Фонда са разпределени в 11 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 28.02.2007г. възлиза на 69.24%.

Чуждестранните ценни книжа, които дават експозиция към доходността на акции на международни компании - сини чипове и компании от развиващите се пазари, представляват 9.64% от стойността на портфейла на Фонда.

Корпоративните облигации представляват 4.35% от стойността на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Банковите депозити съставляват 15.20% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 28.02.2007г. са 1.05% от стойността на портфейла.

Вземания във връзка със записването на акции от увеличението на капитала на едно дружество със специална инвестиционна цел, търгувано на БФБ-София АД, начислени дивиденди, както и авансово платена такса за поддържане на емисия на БФБ представляват 0.51% от активите.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 28.02.2007г. е 26.60% на годишна база*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е 36.77%.

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 8 199 525 лева към 31.01.2007г. до 9 210 860 лева към 28.02.2007г.

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		
	31.12.2006	31.1.2007	28.2.2007
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	1 989 852	826 194	1 507 385
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	331	10	25
Други разходи	8 110	1 608	3 755
Разходи за външни услуги	87 888	12 888	25 207
Общо разходи	2 086 181	840 700	1 536 372

Общият размер на разходите на фонда към 28.02.2007 г. е 1 536 372 лева, които включват 1 507 385 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 25 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 28 февруари 2007г. – 24 512 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.299 %

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

- към 28 февруари 2007г. – 2 671 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.033%

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 28 февруари 2007г. – 400 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.005%

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

- към 28 февруари 2007г. – 70 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.001%

д) Други разходи

- към 28 февруари 2007г. – 1 308 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.016%

- Други разходи по финансови операции: 1 083 лв.

- Външни услуги (КФН и БФБ): 225 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 30 269 лв. към месец февруари. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 0.369 %.

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

Долната таблица представя приходите на Фонда към 28.02.2007. Приходите са в размер на 2 654 969 лв, включващи приходи от операции с финансови активи, приходи от лихви и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лева		
	31.12.2006	31.1.2007	28.2.2007
Приходи от лихви	67 677	4 729	10 257
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	2 953 857	1 514 625	2 654 969
Други финансови приходи	44 367	0	0
Общо приходи	3 065 901	1 519 354	2 665 226

II. Данни по чл. 18, ал. 2

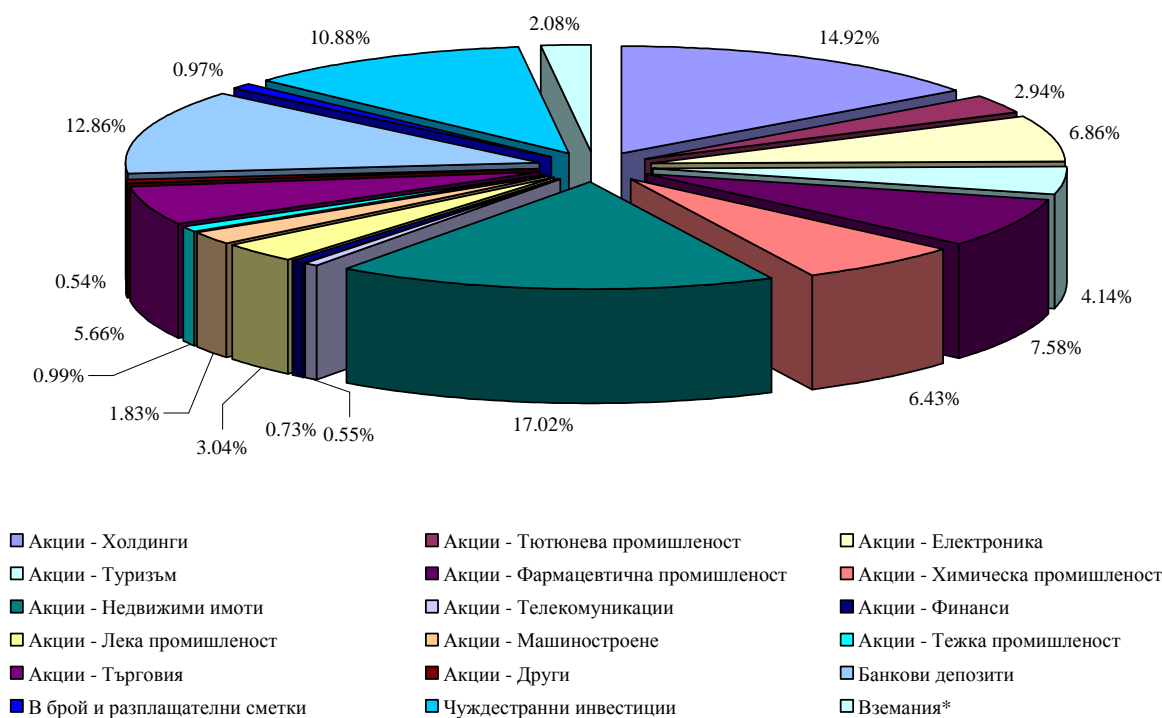
1) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла в началото и в края на отчетния период

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 31/01/2007		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинг	1 223 457	14.92%
Акции - Тютюнева промишленост	240 741	2.94%
Акции - Електроника	562 171	6.86%
Акции - Туризм	339 609	4.14%
Акции - Фармацевтична промишленост	621 138	7.58%
Акции - Химическа промишленост	527 264	6.43%
Акции - машиностроене	150 040	1.83%
Акции - Лека промишленост	293 000	3.57%
Акции и права - Недвижими имоти	1 395 867	17.02%
Акции - Телекомуникации	44 689	0.55%
Акции - Тежка промишленост	80 865	0.99%
Акции - Финанси	59 920	0.73%
Акции - други	464 249	5.66%
Банкови депозити	1 054 162	12.86%
В брой и разплащателни сметки	79 487	0.97%
Чуждестранни инвестиции	892 179	10.88%
Вземания*	170 688	2.08%
Обща сума	8 199 525	100.00%

* Вземания във връзка със записването на акции от увеличението на капитала на едно дружество със специална инвестиционна цел, търгувано на БФБ-София АД, вземания от продажба на права, както и начислени дивиденди

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/01/2007



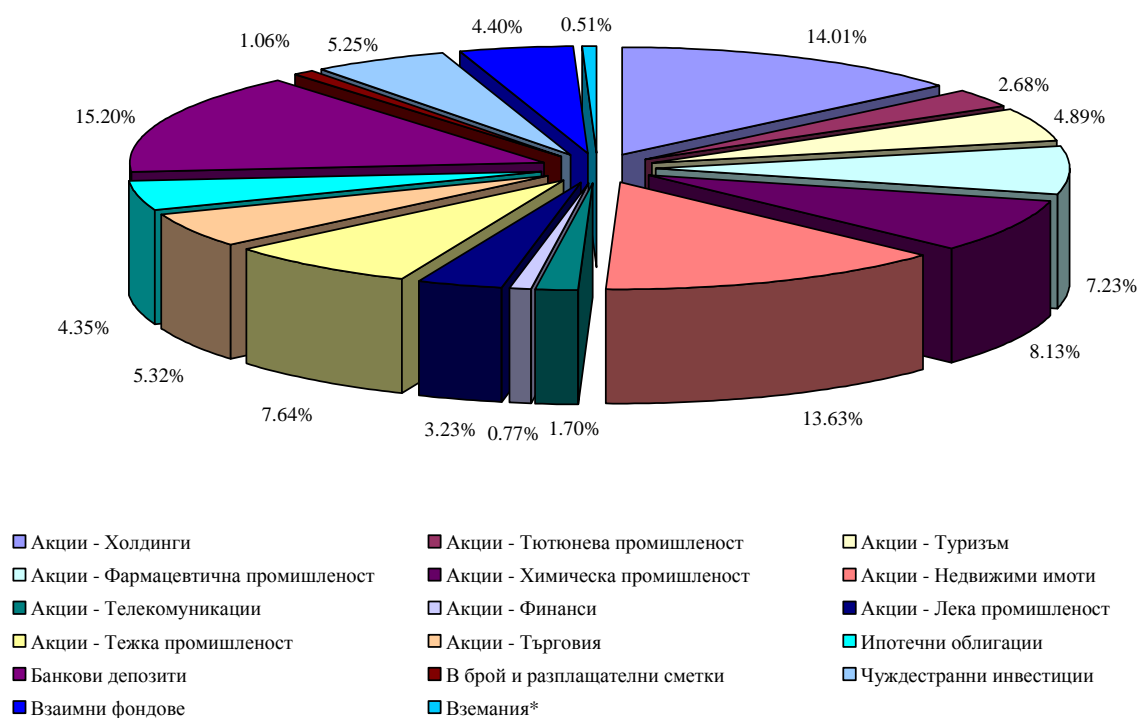
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик в края на отчетния период е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 28/02/2007		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
<i>Акции - Холдинги</i>	<i>1 290 139</i>	<i>14.01%</i>
<i>Акции - Тютюнева промишленост</i>	<i>246 713</i>	<i>2.68%</i>
<i>Акции - Туризм</i>	<i>450 460</i>	<i>4.89%</i>
<i>Акции - Фармацевтична промишленост</i>	<i>666 263</i>	<i>7.23%</i>
<i>Акции - Химическа промишленост</i>	<i>748 967</i>	<i>8.13%</i>
<i>Акции и права - Недвижими имоти</i>	<i>1 255 809</i>	<i>13.63%</i>
<i>Акции - Телекомуникации</i>	<i>156 912</i>	<i>1.70%</i>
<i>Акции - Финанси</i>	<i>70 497</i>	<i>0.77%</i>
<i>Акции - Лека промишленост</i>	<i>297 599</i>	<i>3.23%</i>
<i>Акции - Тежка промишленост</i>	<i>703 622</i>	<i>7.64%</i>
<i>Акции - Търговия</i>	<i>490 475</i>	<i>5.32%</i>
<i>Ипотечни облигации</i>	<i>400 468</i>	<i>4.35%</i>
<i>Банкови депозити</i>	<i>1 400 266</i>	<i>15.20%</i>
<i>В брой и разплащателни сметки</i>	<i>97 503</i>	<i>1.06%</i>

Чуждестранни инвестиции	483 450	5.25%
Взаимни фондове	404 857	4.40%
Вземания*	46 861	0.51%
Обща сума	9 210 860	100.00%

* Вземания във връзка със записването на акции от увеличението на капитала на едно дружество със специална инвестиционна цел, търгувано на БФБ-София АД, начислени дивиденди и авансово платена такса за поддържане на емисия на БФБ - София АД.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 28/02/2007



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

Към 31 януари 2007г. други активи на Фонда представляват вземания във връзка със записването на акции от увеличението на капитала на едно дружество със специална инвестиционна цел, търгувано на БФБ-София АД, вземания от продажба на права, както и начислени дивиденди

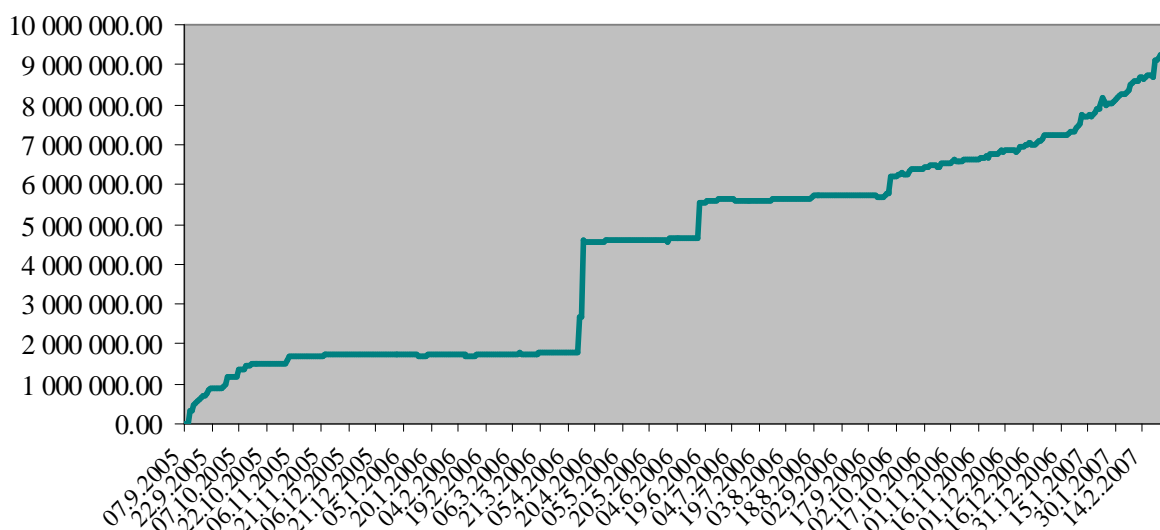
Към 28 февруари 2007г. други активи на Фонда представляват вземания във връзка със записването на акции от увеличението на капитала на едно дружество със специална инвестиционна цел, търгувано на БФБ-София АД, начислени дивиденди и авансово платена такса за поддържане на емисия на БФБ

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

На 31.01.2007г. е изчислена нетна стойност на активите в размер на 8 170 587 лв. Към 28.02.2007г. нетната стойност на активите нараства до 9 133 884 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

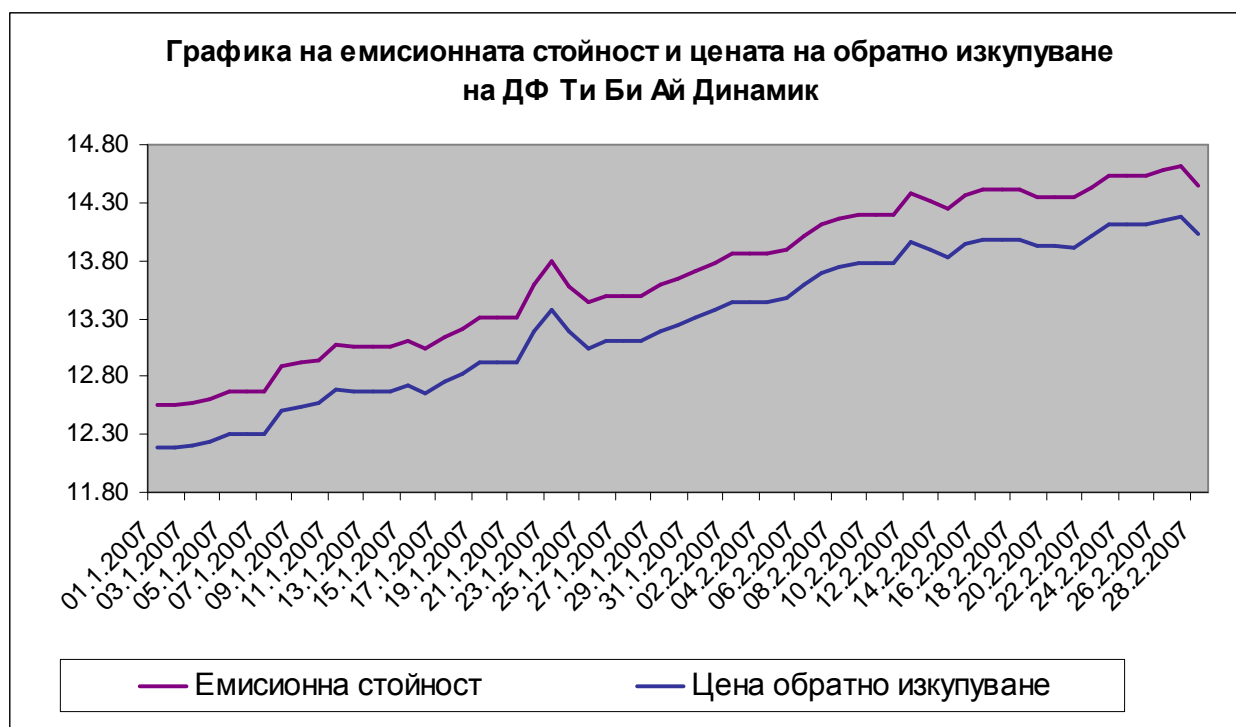
Средната месечна нетна стойност на активите на Фонда е 8 749 705 лева.

Средната годишна нетна стойност на активите е 8 211 712 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 01/02/2007 – 28/02/2007 е представена в таблицата и графиката и по-долу:

Дата	Емисионна стойност	Цена обратно изкупуване
01.2.2007	13.7843	13.3789
02.2.2007	13.8544	13.4469
03.2.2007	13.8544	13.4469
04.2.2007	13.8544	13.4469
05.2.2007	13.8919	13.4833
06.2.2007	14.0060	13.5941
07.2.2007	14.1089	13.6940
08.2.2007	14.1608	13.7443
09.2.2007	14.2033	13.7856
10.2.2007	14.2033	13.7856
11.2.2007	14.2033	13.7856
12.2.2007	14.3831	13.9601
13.2.2007	14.3148	13.8938
14.2.2007	14.2533	13.8341
15.2.2007	14.3611	13.9387
16.2.2007	14.4096	13.9858
17.2.2007	14.4096	13.9858
18.2.2007	14.4096	13.9858
19.2.2007	14.3478	13.9258
20.2.2007	14.3547	13.9325
21.2.2007	14.3396	13.9178
22.2.2007	14.4300	14.0056
23.2.2007	14.5362	14.1087
24.2.2007	14.5362	14.1087
25.2.2007	14.5362	14.1087
26.2.2007	14.5800	14.1512
27.2.2007	14.6177	14.1878
28.2.2007	14.4501	14.0251



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

През месец февруари са записани 42 492.2004 дяла.

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

дата	операция	брой дялове	емисионна стойност	сума лв.
01.2.2007	записване	632.1617	13.7082	8 665.80
02.2.2007	записване	796.5556	13.7843	10 979.96
05.2.2007	записване	144.3584	13.8544	2 000.00
06.2.2007	записване	579.4744	13.8919	8 050.00
07.2.2007	записване	4 865.5397	14.0060	68 146.75
09.2.2007	записване	1 694.8195	14.1608	24 000.00
12.2.2007	записване	35.2031	14.2033	500.00
13.2.2007	записване	568.3684	14.3831	8 174.90
14.2.2007	записване	223.9528	14.3148	3 205.84
15.2.2007	записване	350.7960	14.2533	5 000.00
16.2.2007	записване	278.5302	14.3611	4 000.00
19.2.2007	записване	407.1244	14.4096	5 866.50
20.2.2007	записване	27 708.0807	14.3478	397 550.00
22.2.2007	записване	1 354.4423	14.3396	19 422.16
23.2.2007	записване	2 156.7152	14.4300	31 121.40
26.2.2007	записване	181.6747	14.5362	2 640.86
27.2.2007	записване	514.4033	14.5800	7 500.00

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

През месец февруари са изкупени обратно 5 710.0000 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.
28.Февруари.07	обратно изкупуване	5 710.0000	14.1878	81 012.34

В резултат на посочените по-горе записвания и обратни изкупувания, към 28.02.2007г. общият брой на дяловете на Фонда възлиза на 644 740.8484 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.Февруари.07	покупки	недвижими имоти	380	532
02.Февруари.07	покупки	тежка промишленост	55	10455
02.Февруари.07	продажби	тежка промишленост	350	69597
05.Февруари.07	покупки	фармацевтична промишленост, холдинги	2785	26030.85
06.Февруари.07	покупки	фармацевтична промишленост, холдинги, търговия	1662	15584.7
06.Февруари.07	продажби	фармацевтична промишленост, холдинги, тежка промишленост, търговия, лека промишленост	10058	87551.6
07.Февруари.07	покупки	холдинги	248	4011.8
07.Февруари.07	продажби	холдинги	2030	24120.31
08.Февруари.07	покупки	холдинги, тежка промишленост	16622	161202.62
08.Февруари.07	продажби	недвижими имоти	61645	89097.75
09.Февруари.07	покупки	туризъм, лека промишленост	3245	87959.68
09.Февруари.07	продажби	лека промишленост	2297	6431.6
12.Февруари.07	покупки	туризъм	222	20668

12.Февруари.07	продажби	холдинги, тежка промишленост, търговия, лека промишленост	6954	130407.25
13.Февруари.07	покупки	лека промишленост	358	11456
13.Февруари.07	продажби	лека промишленост	2000	5840
14.Февруари.07	покупки	недвижими имоти, търговия	838	26816
14.Февруари.07	продажби	лека промишленост	3300	19635
15.Февруари.07	продажби	лека промишленост, туризъм, търговия	1022	39819.72
16.Февруари.07	покупки	фармацевтична промишленост, химическа промишленост	312	3123
16.Февруари.07	продажби	лека промишленост, търговия	763	8359.1
19.Февруари.07	покупки	холдинги, търговия	422	9695.12
19.Февруари.07	продажби	лека промишленост, търговия	3300	17280
20.Февруари.07	покупки	фармацевтична промишленост, холдинги, телекомуникации	12540	134297.15
20.Февруари.07	продажби	лека промишленост	3000	9690
21.Февруари.07	покупки	фармацевтична промишленост, холдинги	268	2095.2
22.Февруари.07	покупки	фармацевтична промишленост, холдинги, тежка промишленост	2050	21624.16
22.Февруари.07	продажби	лека промишленост, холдинги, тежка промишленост	3397	21910.11
23.Февруари.07	покупки	фармацевтична промишленост, холдинги, тежка промишленост, лека промишленост	3950	31241
23.Февруари.07	продажби	лека промишленост, търговия, холдинги	11001	108643.12
26.Февруари.07	покупки	фармацевтична промишленост, холдинги	2175	14791.9
26.Февруари.07	продажби	холдинги	46	408.02
27.Февруари.07	покупки	фармацевтична промишленост, холдинги, лека промишленост, ипотечни облигации	3553	430117.77
27.Февруари.07	продажби	тежка промишленост, търговия	3267	62721

28.Февруари.07	покупки	фармацевтична промишленост, холдинги, химическа промишленост, търговия, лека промишленост	8489	85998.83
28.Февруари.07	продажби	недвижими имоти, фармацевтична промишленост	83260	156174.16

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