

**ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО
ЧЛ. 48 и ЧЛ. 73Г ОТ НАРЕДБА № 25 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА
НА ИНВЕСТИЦИОННИТЕ ДРУЖЕСТВА И ДОГОВОРНИ ФОНДОВЕ ЗА
ДОГОВОРЕН ФОНД „ТИ БИ АЙ ДИНАМИК”**

I. 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 30.09.2010г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик са разпределени в 9 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 30.09.2010г. възлиза на 65.36%.

Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 30.09.2010г. възлизат на 19.16% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 9.96% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.09.2010г. са 4.16% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с дивиденди, лихвено плащане, както и предварително платена такса на БФБ и ЦД възлизат на 1.36% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.09.2010г. е минус 3,06% на годишна база*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 14.08%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 30.09.2010г. е минус 5.23%, а доходността от началото на годината е минус 0.72%.

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 30.09.2010г. Приходите са в размер на 3 443 473 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.



Асет Мениджмънт

Приходи	Стойност в лева		
	31.3.2010	30.6.2010	30.9.2010
Приходи от лихви	7 350	13 618	19 449
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	733 600	1 900 807	3 007 286
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	75 816	244 892	383 731
Други финансови приходи	673	7 657	33 007
Общо приходи	817 439	2 166 974	3 443 473

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

Разходи	Стойност в лева		
	31.3.2010	30.6.2010	30.9.2010
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	744 726	2 120 463	3 044 501
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	76 244	246 097	384 773
Други разходи	1 510	2 947	3 569
Разходи за външни услуги	15 185	29 593	43 558
Общо разходи	837 665	2 399 100	3 476 401

Общият размер на разходите на фонда към 30.09.2010г . е 3 476 401 лева, които включват 3 044 501 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти, 384 773 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество
 - към 30.09.2010г – 39 032 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1,3464%
- б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество
 - към 30.09.2010г – 1 709 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.0590%
- в) Възнаграждение на банката депозитар
 - към 30.09.2010г – 1 800 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.0621%
- г) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие
 - към 30.09.2010г – 1 800 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.0621%
- д) Други разходи
 - към 30.09.2010г – 2 786 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.0961%



Асет Мениджмънт

- Други разходи по финансови операции: 1 860 лв.
- Външни услуги (КФН, БФБ, ЦД и други услуги): 926 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 47 127 лв. към месец септември. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 1,6257 %.

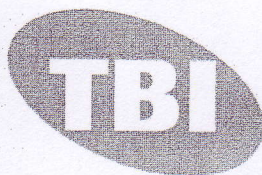
За периода са записани 2 175,8353 дяла и са обратно изкупени 3 847,2634 дяла. НСА на фонда към 30.06.2010г. е 2 649 862,92 лв., а към 30.09.2010г. е 2 835 598,04 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 331 228,4936.

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.

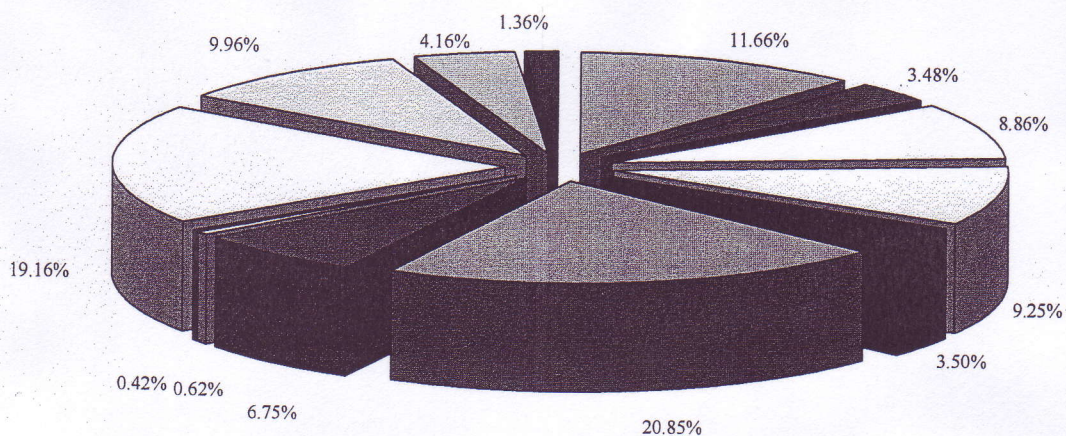
Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 30/09/2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	331 121	11.66%
Акции - Тююнева промишленост	98 808	3.48%
Акции - Туризм	251 658	8.86%
Акции - Фармацевтична промишленост	262 768	9.25%
Акции - Енергетика	99 351	3.50%
Акции - Недвижими имоти	592 185	20.85%
Акции - Тежка промишленост	191 628	6.75%
Акции - Услуги	17 528	0.62%
Акции - Финанси	11 809	0.42%
Чуждестранни инвестиции	544 245	19.16%
Банкови депозити	283 000	9.96%
В брой и разплащателни сметки	118 100	4.16%
Вземания*	38 681	1.36%
Обща сума	2 840 882	100.00%

* Вземания във връзка с дивиденди, лихвено плащане, хеджираща сделка, както и предварително платена такса на БФБ и КФН



Асет Мениджмънт

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 30/09/2010



- | | | |
|--------------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| ■ Акции - Холдинги | ■ Акции - Тютюнева промишленост | □ Акции - Туризм |
| □ Акции - Фармацевтична промишленост | ■ Акции - Енергетика | □ Акции - Недвижими имоти |
| ■ Акции - Тежка промишленост | □ Акции - Услуги | ■ Акции - Финанси |
| □ Чуждестранни инвестиции | □ Банкови депозити | □ В брой и разплащателни сметки |
| ■ Вземания* | | |

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

На 30.06.2010г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 7,9599 лв. Към 30.09.2010г. нетната стойност на активите на един дял е 8,5609 лв.

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



Асет Мениджмънт



II. Данни по чл. 48, ал. 3, т. 2 от Наредба № 25

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 са описани по-долу.

Рисков актив				
ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
Валутно деноминиран актив	USD	2790,000	21,3391	\$59 536,09
Валутно деноминиран актив	USD	2350,000	39,6200	\$93 107,00
Валутно деноминиран актив	USD	850,000	74,6299	\$63 435,42
Валутно деноминиран актив	USD	1450,000	42,8949	\$62 197,61

Обща рискова позиция	\$278 276,11
----------------------	--------------

Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 215 000,00	1,268010	\$272 622,15	OTC	България

Обща хеджираща позиция	\$272 622,15
------------------------	--------------

Стоян Тошев
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

