
**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 30.06.2010г. 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 30.06.2010г. възлиза на 64,77%.

Корпоративните облигации в портфейла представляват 1,67% от активите на Ти Би Ай Динамик. Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 30.06.2010г. възлизат на 21,96% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 10,45% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.06.2010г. са 0,79% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с лихвено плащане, с хеджиращи операции, както и предварително платена такса на БФБ възлизат на 0,36% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.06.2010г. е минус 4,68% на годишна база*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 15,42%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 30.06.2010г. е 1,66%, а доходността от началото на годината е минус 7,69%.

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 30.06.2010г. Приходите са в размер на 2 166 974 лв, включващи приходи от операции с финансови активи, приходи от лихви, приходи от положителни валутни курсови разлики и други финансови приходи.

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

Приходи	Стойност в лева		
	30/12/2009	31/03/2010	30/06/2010
Приходи от лихви	38 998	7 350	13 618
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	5 806 841	733 600	1 900 807
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	51 740	75 816	244 892
Други финансови приходи	110 692	673	7 657
Общо приходи	6 008 271	817 439	2 166 974

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

Разходи	Стойност в лева		
	30.12.2009	31.3.2010	30.6.2010
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	5 931 860	744 726	2 120 463
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	52 937	76 244	246 097
Други разходи	13 313	1 510	2 947
Разходи за външни услуги	62 963	15 185	29 593
Общо разходи	6 061 073	837 665	2 399 100

Общият размер на разходите на фонда към 30.06.2010г. е 2 399 100 лева, които включват 2 120 463 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти, 246 097 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество
 - към 30.06.2010г. – 26 528 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.89%
- б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество
 - към 30.06.2010г. – 1 529 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.05%
- в) Възнаграждение на банката депозитар
 - към 30.06.2010г. – 1 200 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.04%
- г) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие
 - към 30.06.2010г. – 1 200 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.04%
- д) Други разходи
 - към 30.06.2010г. – 2 083 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.07%

- Други разходи по финансови операции: 1 418 лв.

- Външни услуги (КФН, БФБ, ЦД и други услуги): 665 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 32 540 лв. към месец юни. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 1.10 %.

За периода са записани 6 552,1277 дяла и са обратно изкупени 15 880,9047 дяла. НСА на фонда към 31.03.20010г. е 2 933 922,70 лв., а към 30.06.20010г. е 2 649 862,92 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 332 899,9217.

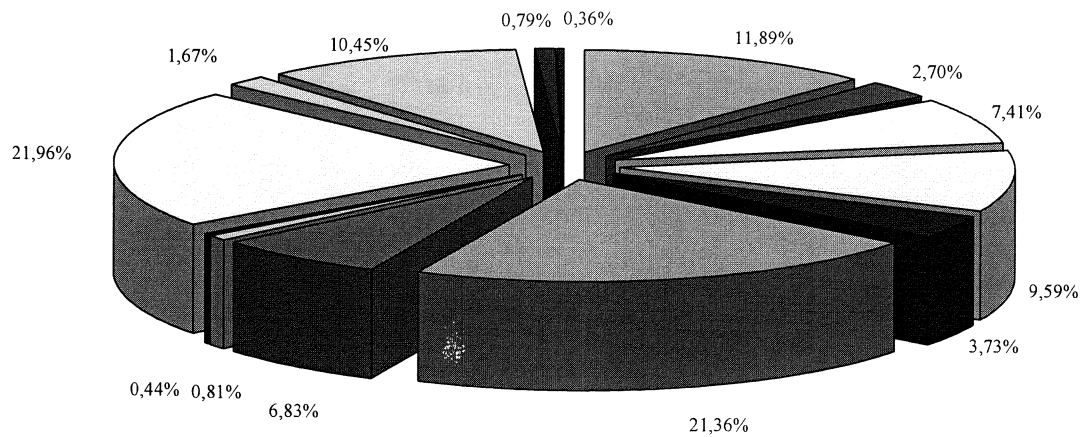
3) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „в”: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

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 30/06/2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	315 975	11.89%
Акции - Тютюнева промишленост	71 819	2.70%
Акции - Туризм	196 980	7.41%
Акции - Фармацевтична промишленост	254 786	9.59%
Акции - Енергетика	98 989	3.73%
Акции - Недвижими имоти	567 574	21.36%
Акции - Тежка промишленост	181 418	6.83%
Акции - Услуги	21 623	0.81%
Акции - Финанси	11 601	0.44%
Чуждестранни инвестиции	583 349	21.96%
Облигации	44 497	1.67%
Банкови депозити	277 688	10.45%
В брой и разплащателни сметки	20 877	0.79%
Вземания*	9 486	0.36%
Обща сума	2 656 661	100.00%

* Вземания във връзка с лихвено плащане, с хеджиращи операции, както и предварително платена такса на БФБ

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 30/06/2010

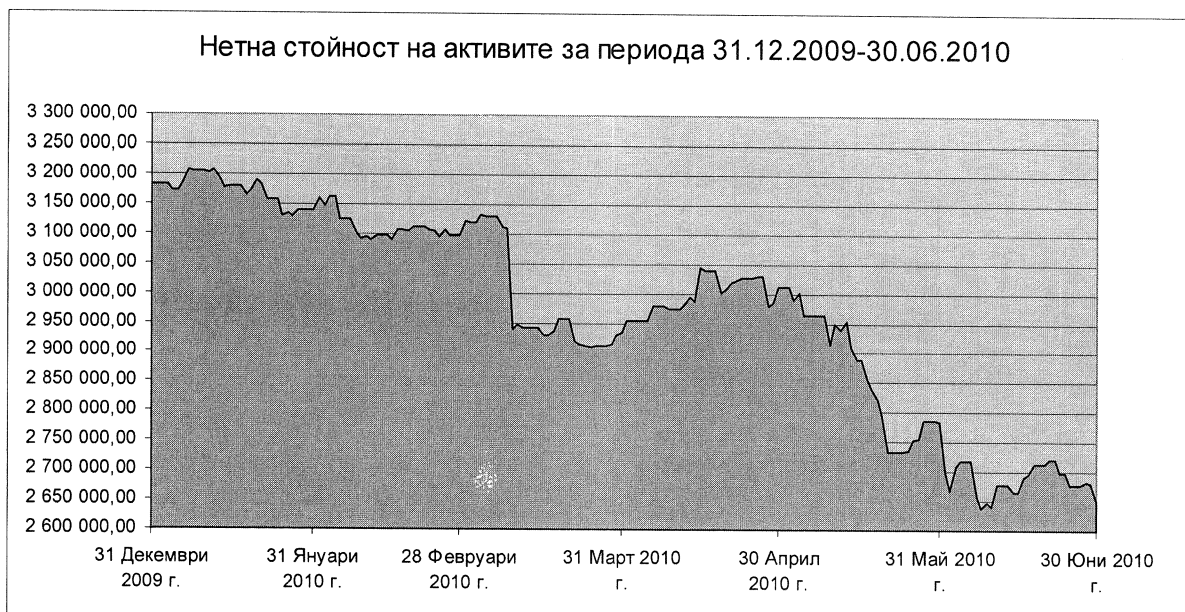


- | | | |
|--------------------------------------|---------------------------------|---------------------------|
| ■ Акции - Холдинги | ■ Акции - Тютюнева промишленост | □ Акции - Туризм |
| □ Акции - Фармацевтична промишленост | ■ Акции - Енергетика | ■ Акции - Недвижими имоти |
| ■ Акции - Тежка промишленост | □ Акции - Услуги | ■ Акции - Финанси |
| □ Чуждестранни инвестиции | □ Облигации | □ 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 31.03.20010г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на е 8,5730 лв . На 30.06.20010г. нетната стойност на активите на един дял е 7,9599 лв.

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



II. Данни по чл. 48, ал. 3, т. 2 от 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	2 790,000	19,6895	\$54 933,71
Валутно деноминиран актив	USD	2 350,000	32,9200	\$77 362,00
Валутно деноминиран актив	USD	850,000	62,8660	\$53 436,10
Валутно деноминиран актив	USD	1 450,000	40,0627	\$58 090,92
Обща рискова позиция				\$243 822,73

Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 233 000,00	1,202920	\$280 280,36	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$280 280,36		

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

