

---

**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.

Към 30.09.2008 г. акциите на български компании в портфейла на Фонда са разпределени в 12 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 30.09.2008г. възлиза на 76,75%.

Фондът е закупил дялове на взаимен фонд, с експозиция към китайския фондов пазар, както и акции на чуждестранни пазари. Тези инвестиции към 30.09.2008г възлизат на 5,33% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 17,50% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.09.2008г. са 0.29% от стойността на портфейла.

Вземания във връзка с начислени дивиденди и авансово платена такса за поддържане на емисия на БФБ - София АД представляват 0,13% от активите.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.09.2008г. е 8,35% на годишна база\*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е -1,66%. А доходността на Фонда за последния едногодишен период до 30.09.2008 г. е -42,26%.

**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 30.09.2008г. Приходите са в размер на 18 264 582 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		
	31.3.2008	30.6.2008	30.9.2008
Приходи от лихви	43 892	72 318	102 689
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	7 249 746	12 771 265	17 319 339
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	261 106	500 822	724 590
Други финансови приходи	658	85 227	117 964
<b>Общо приходи</b>	<b>7 555 402</b>	<b>13 429 632</b>	<b>18 264 582</b>

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

Разходи	Стойност в лева		
	31.3.2008	30.6.2008	30.9.2008
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	11 156 379	17 779 875	25 833 770
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	258 244	493 979	715 979
Други разходи	4 112	6 039	11 132
Разходи за външни услуги	89 846	163 131	223 197
<b>Общо разходи</b>	<b>11 508 581</b>	<b>18 443 024</b>	<b>26 784 078</b>

Общият размер на разходите на фонда към 30.09.2008г. е 26 784 078 лева, които включват 25 833 770 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 715 979 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 30 септември 2008г. – 218 629 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1,331 %

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

- към 30 септември 2008г. – 8 559 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.052%

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 30 септември 2008г. – 2 093 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.013%

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

- към 30 септември 2008г. – 1 800 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.011%

д) Други разходи

- към 30 септември 2008г. – 3 249 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.020%

- Други разходи по финансови операции: 2 574 лв.
- Външни услуги (КФН и БФБ): 675 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 234 330 лв. към месец септември. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 1,427 %.

За периода са записани 4 616,9485 дяла и са обратно изкупени 96 380,4414 дяла. НСА на фонда към 30.06.2008г. е 15 350 266 лв., а към 30.09.2008г. е 10 463 424 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 817 218,3496.

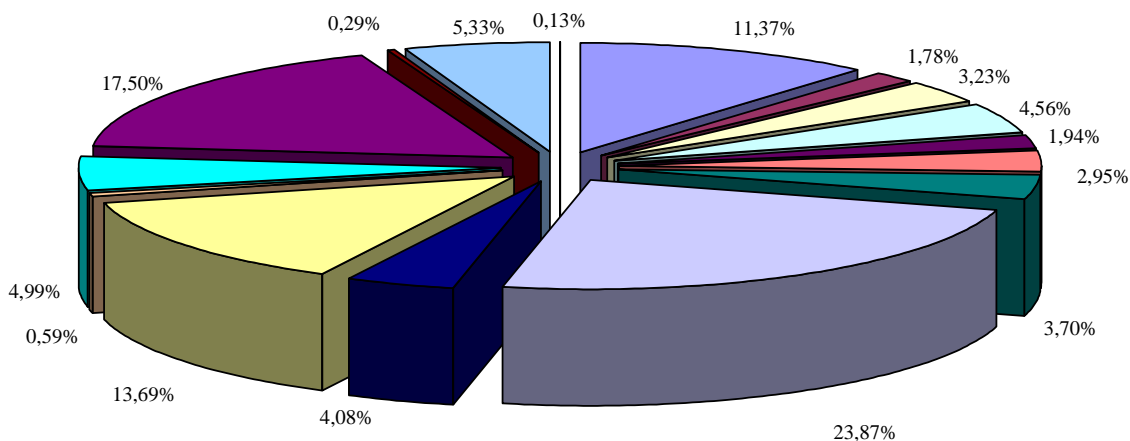
### 3) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „в”: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

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 30/09/2008		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	1 194 528	11,37%
Акции - Тютюнева промишленост	187 105	1,78%
Акции - Туризм	339 639	3,23%
Акции - Фармацевтична промишленост	479 066	4,56%
Акции - Енергетика	203 484	1,94%
Акции - Финанси	310 143	2,95%
Акции - Химическа промишленост	388 959	3,70%
Акции - Недвижими имоти	2 507 155	23,87%
Акции - Лека промишленост	428 074	4,08%
Акции - Тежка промишленост	1 438 079	13,69%
Акции - Хранително-вкусова промишленост	61 516	0,59%
Акции - Услуги	523 742	4,99%
Банкови депозити	1 838 104	17,50%
В брой и разплащателни сметки	30 486	0,29%
Чуждестранни инвестиции - взаимни фондове	560 218	5,33%
Вземания*	13 823	0,13%
Обща сума	10 504 119	100,00%

\*Вземания във връзка с начислени дивиденди и лихви по депозити

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 30/09 /2008**

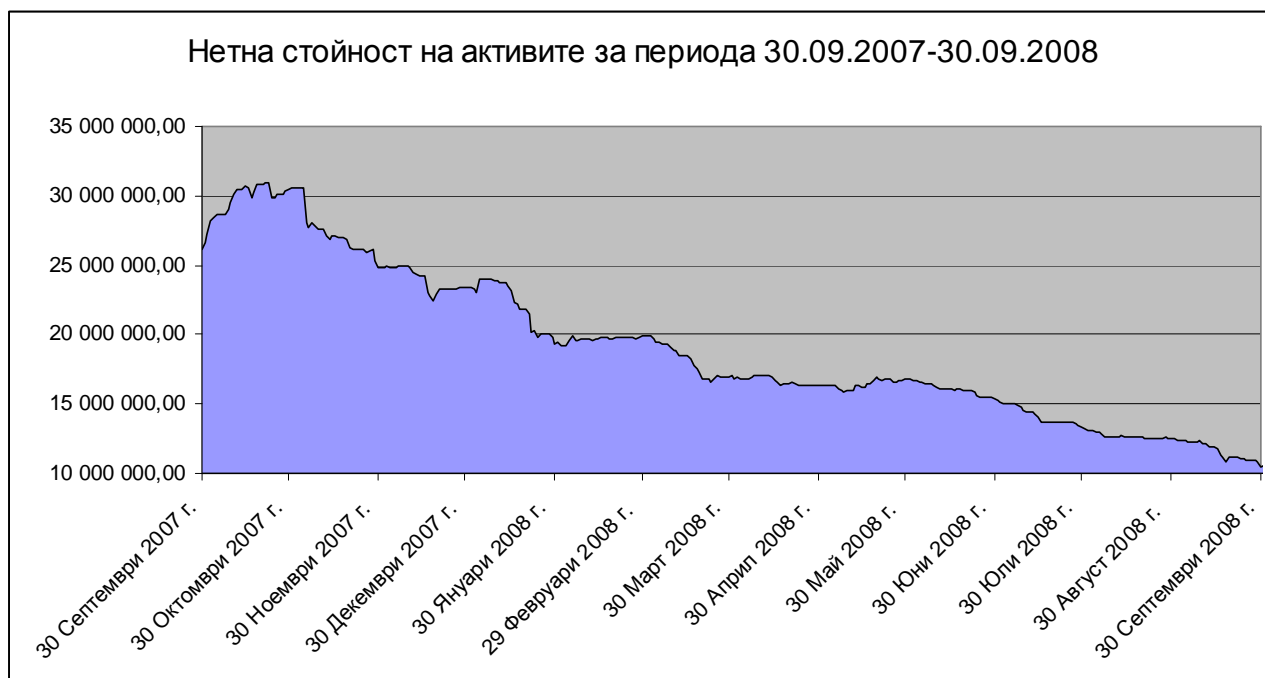


- Акции - Холдинги
- Акции - Туризм
- Акции - Енергетика
- Акции - Химическа промишленост
- Акции - Лека промишленост
- Акции - Хранително-вкусова промишленост
- Банкови депозити
- Чуждестранни инвестиции - взаимни фондове
- Акции - Тютюнева промишленост
- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Финанси
- Акции - Недвижими имоти
- Акции - Тежка промишленост
- Акции - Услуги
- 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 30.06.2008 г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 16,8873 лв. Към 30.09.2008 г. нетната стойност на активите на един дял е 12,8037 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
LU0168045416	USD	790	261,252	\$206 348,85
US3682872078	USD	3 300	29,260	\$96 558,00
US6778621044	USD	1 900	56,200	\$106 780,00

<b>Обща рискова позиция</b>	<b>\$409 686,85</b>
-----------------------------	---------------------

### Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	USD/EUR	€ 288 000,00	1,47223	\$424 002,24	OTC	България

<b>Обща хеджираща позиция</b>	<b>\$424 002,24</b>
-------------------------------	---------------------

Стоян Тошев  
 Изпълнителен директор  
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД