

**ИНФОРМАЦИЯ,
СЪГЛАСНО ЧЛ. 48 ОТНАРЕДБА № 25 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА
ИНВЕСТИЦИОННИТЕ ДРУЖЕСТВА И ДОГОВОРНИ ФОНДОВЕ**

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 28.12.2007 г. акциите на български компании в портфейла на Фонда са разпределени в 9 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 28.12.2007г. възлиза на 65,09%. Чуждестранните акции в портфейла на Фонда към 28.12.2007г. представляват 0,99% от активите на Фонда.

Фондът е закупил дялове на взаимни фондове, които инвестират в Източна Европа и в компании на възникващите пазари. Тези инвестиции към 28.12.2007г. възлизат на 9,91% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 15,28% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 28.12.2007г. са 0.20% от стойността на портфейла.

Вземания във връзка с участието в увеличението на капитала на пет дружества представляват 8,53% от активите.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 28.12.2007г. е 39,84% на годишна база*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е 38,66%. А доходността на Фонда за последния едногодишен период до 28.12.2007 г. е 76,08%.

I. Данни по чл. 48, ал. 3 от Наредба № 25**1) Данни по чл. 48, ал. 3 т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти**

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

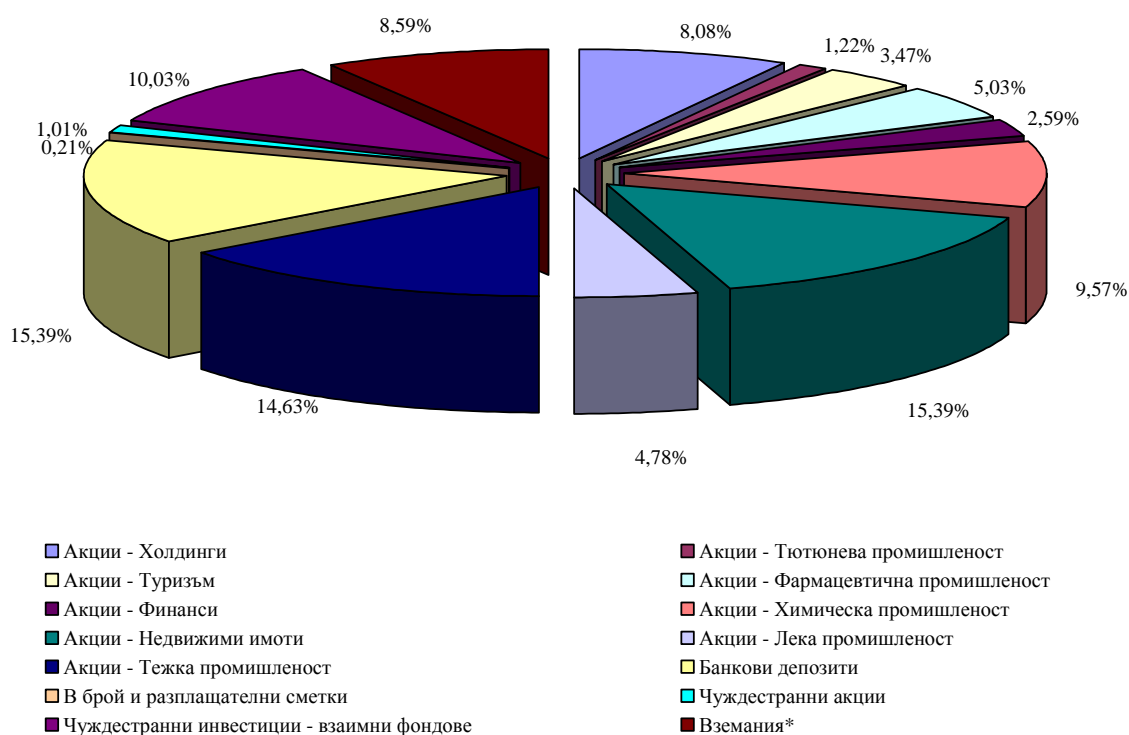
| Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 28/12/2007 | | |
|---|------------------------|----------------------------|
| Актив | Стойност в лева | Процент от активите |
| Акции - Холдинги | 1 897 446 | 8,08% |
| Акции - Тютюнева промишленост | 287 490 | 1,22% |
| Акции - Туризъм | 814 593 | 3,47% |
| Акции - Фармацевтична промишленост | 1 182 261 | 5,03% |
| Акции - Финанси | 608 926 | 2,59% |
| Акции - Химическа промишленост | 2 248 143 | 9,57% |
| Акции - Недвижими имоти | 3 616 931 | 15,39% |

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

| | | |
|---|------------|---------|
| Акции - Лека промишленост | 1 123 735 | 4,78% |
| Акции - Тежка промишленост | 3 436 853 | 14,63% |
| Банкови депозити | 3 615 638 | 15,39% |
| В брой и разплащателни сметки | 48 307 | 0,21% |
| Чуждестранни акции | 238 279 | 1,01% |
| Чуждестранни инвестиции - взаимни фондове | 2 357 519 | 10,03% |
| Вземания* | 2 018 674 | 8,59% |
| Обща сума | 23 494 796 | 100,00% |

* Вземания във връзка с участието в увеличението на капитала на пет дружества

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 28/12/2007



2) 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 |
|--------------|--------|--------|--------|---------------|
| LU0168045416 | USD | 1 580 | 526,84 | \$832 322,91 |
| US3682872078 | USD | 12 400 | 14,43 | \$178 992,64 |

| | |
|-----------------------------|-----------------------|
| Обща рискова позиция | \$1 011 315,54 |
|-----------------------------|-----------------------|

Дериватен инструмент

| Вид | Валута | Брой | Цена | Обща Стойност | Пазар | Държава |
|-------------------------|---------|-----------------|---------|-----------------|-------|----------|
| Форуърд купува EUR/USD | USD/EUR | € 840 000,00 | 1,48500 | -\$1 247 400,00 | OTC | България |
| Форуърд продава EUR/USD | USD/EUR | € 141 000,00 | 1,4757 | \$208 073,70 | OTC | България |

| | |
|-------------------------------|------------------------|
| Обща хеджираща позиция | -\$1 039 326,30 |
|-------------------------------|------------------------|

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД