



# Асет Мениджмънт

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

### ДФ Ти Би Ай Динамик

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 31.01.2011г. 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 31.01.2011г възлиза на 58,58%.

Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 31.01.2011г възлизат на 18,48% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 17,24% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.01.2011г са 4,80% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с хеджиращи сделки, както и предварително платени такси към БФБ и ЦД възлизат на 0,90% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.01.2011г. е минус 2,41% на годишна база\*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 12,81%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 31.01.2011г е 3,23%.

### 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.

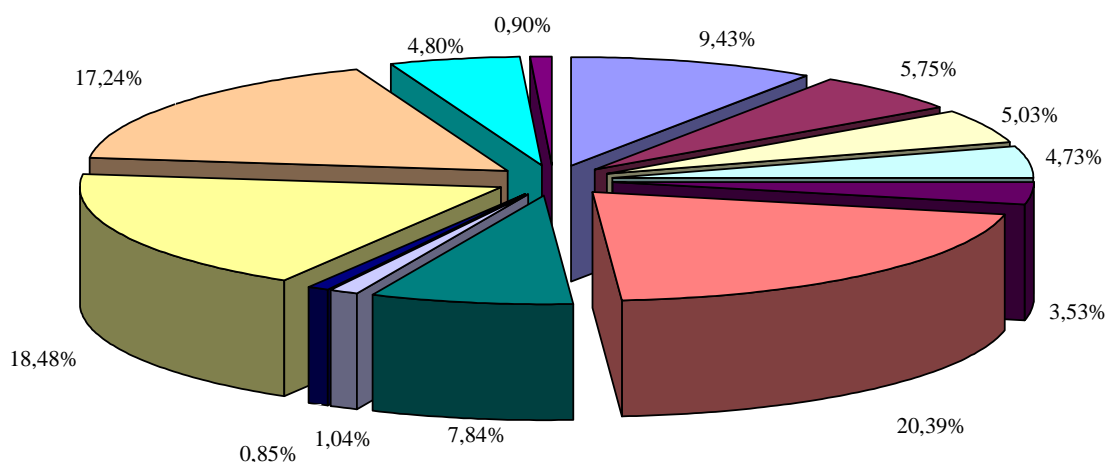
Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31/01/2011		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	267 912	9,43%
Акции - Тютюнева промишленост	163 413	5,75%
Акции - Туризм	142 768	5,03%
Акции - Фармацевтична промишленост	134 324	4,73%
Акции - Енергетика	100 162	3,53%
Акции - Недвижими имоти	579 023	20,39%
Акции - Тежка промишленост	222 517	7,84%
Акции - Услуги	29 450	1,04%
Акции - Финанси	24 081	0,85%

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

Чуждестранни инвестиции	524 776	18,48%
Банкови депозити	489 622	17,24%
В брой и разплащателни сметки	136 429	4,80%
Вземания*	25 476	0,90%
Обща сума	2 839 952	100,00%

\* Вземания във връзка с хеджиране, както и предварително платени такси към БФБ и ЦД

## Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/01/2011



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

## 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
Валутно деноминиран актив	USD	850.000	71.7097	\$60 953.25
Валутно деноминиран актив	USD	1450.000	42.8180	\$62 086.10
Валутно деноминиран актив	USD	3 650.000	23.0200	\$84 023.00
Валутно деноминиран актив	USD	85 138.880	1.0000	\$85 138.88

<b>Обща рискова позиция</b>	<b>\$292 201.23</b>
-----------------------------	---------------------



# Асет Мениджмънт

Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 237 000.00	1.294580	\$306 815.46	ОТС	България
Обща хеджираща позиция				\$306 815.46		

Стоян Тошев  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Мирослав Маринов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД