



Асет Мениджмънт

ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО ЧЛ. 72 ОТНАРЕДБА № 44 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА КИС, ИД ОТ ЗАТВОРЕН ТИП И УД

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 31.10.2011г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик са разпределени в 10 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 31.10.2011г. възлиза на 56.89%.

Банковите депозити съставляват 12,47% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.10.2011г. са 9.10% от стойността на портфейла. Инвестициите в дългови ценни книжа към края на месеца са 18.40% от стойността на портфейла. През месеца са закупени чуждестранни инвестиции, които представляват 3.01% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Вземанията във връзка с предварително платена такса към БФБ и КФН, както и вземания от хеджиране и от продажба на права възлизат на 0.12% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.10.2011г. е минус 3.07% на годишна база*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 13.52%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 31.10.2011г. е минус 2.83%.

I. Данни по чл. 72, ал. 2 от Наредба № 44

1) Данни по чл. 72, ал. 2 т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти

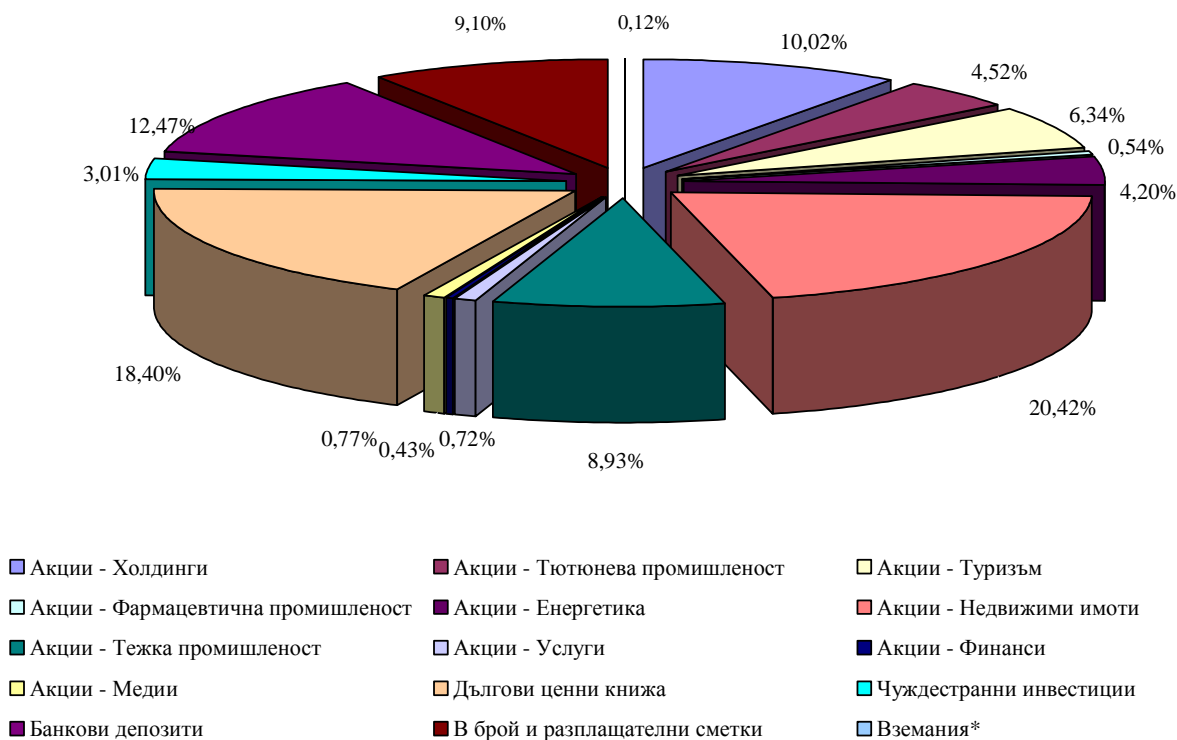
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик в края на периода е представена в следната таблица и графика.

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

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31/10/2011		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	245 065	10,02%
Акции - Тютюнева промишленост	110 519	4,52%
Акции - Туризм	155 034	6,34%
Акции - Фармацевтична промишленост	13 287	0,54%
Акции - Енергетика	102 844	4,20%
Акции - Недвижими имоти	499 629	20,42%
Акции - Тежка промишленост	218 560	8,93%
Акции - Услуги	17 709	0,72%
Акции - Финанси	10 410	0,43%
Акции - Медии	18 888	0,77%
Дългови ценни книжа	450 159	18,40%
Чуждестранни инвестиции	73 746	3,01%
Банкови депозити	305 094	12,47%
В брой и разплащателни сметки	222 578	9,10%
Вземания*	3 056	0,12%
Обща сума	2 446 578	100,00%

* Вземания във връзка с предварително платена такса към БФБ и КФН, както и вземания от хеджиране и от продажба на права

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/10/2011





Асет Мениджмънт

2) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 2 от Наредба № 44

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	57 119,450	1,0000	\$57 119,45

Обща рискова позиция	\$57 119,45
----------------------	-------------

Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 39 000,00	1,348260	\$52 582,14	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$52 582,14		

Мирослав Маринов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД