



Асет Менѝжмънт

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 31.08.2008 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 31.08.2008г. възлиза на 77,82%.

Фондът е закупил дялове на взаимен фонд, с експозиция към китайския фондов пазар, както и акции на Лукойл и Газпром. Тези инвестиции към 31.08.2008г. възлизат на 5,60% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 16,11% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.08.2008г. са 0,14% от стойността на портфейла.

Вземания във връзка с начислени дивиденди, лихви по депозити и авансово платена такса на БФБ представляват 0,33% от активите.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.08.2008г. е 14,38% на годишна база*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е 7,29%. А доходността на Фонда за последния едногодишен период до 31.08.2008 г. е минус 20,46%.

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 31/08/2008		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	1 628 657	12,93%
Акции - Тютюнева промишленост	228 702	1,82%
Акции - Туризмъ	427 571	3,39%
Акции - Фармацевтична промишленост	688 339	5,47%
Акции - Енергетика	267 229	2,12%
Акции - Финанси	379 656	3,01%
Акции - Химическа промишленост	534 153	4,24%
Акции - Недвижими имоти	2 545 813	20,21%
Акции - Лека промишленост	595 045	4,72%
Акции - Тежка промишленост	1 830 215	14,53%
Акции - Хранително-вкусова промишленост	57 670	0,46%
Акции - Услуги	617 420	4,90%
Банкови депозити	2 029 557	16,11%

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

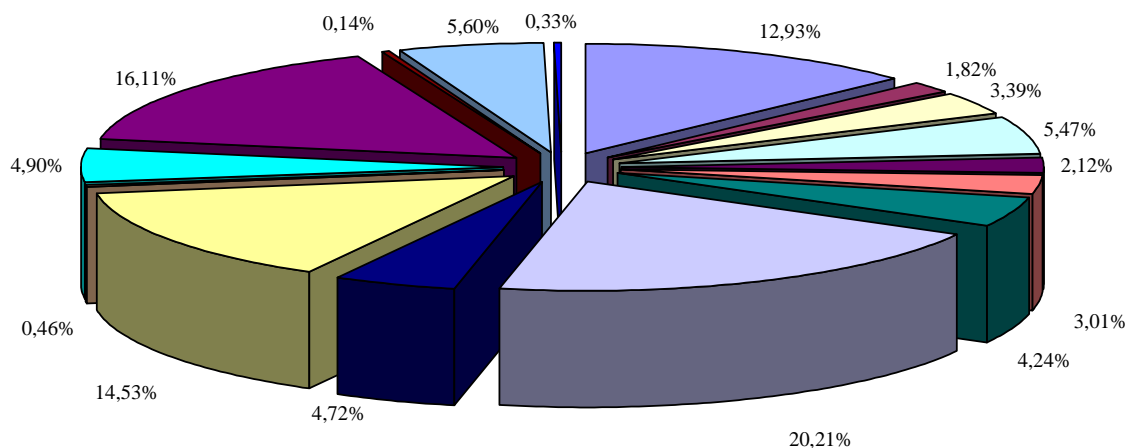


Асет Мениджмънт

В брой и разплащателни сметки	17 205	0,14%
Чуждестранни инвестиции - взаимни фондове	705 739	5,60%
Вземания*	41 470	0,33%
Обща сума	12 594 440	100,00%

*Вземания във връзка с начислени дивиденди, лихви по депозити и авансово платена такса на БФБ

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/08 /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*

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	789.846	323,981	\$255 895,10
US3682872078	USD	3 300	39,530	\$130 449,00
US6778621044	USD	1 900	76,500	\$145 350,00

Обща рискова позиция	\$531 694,10
-----------------------------	--------------



1000 София, ул. Света София 7, ет.6
тел.: +359 2 935 06 11, факс: +359 2 935 06 17

Асет Мениджмънт

Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	USD/EUR	€ 361 000,00	1,47604	\$532 850,44	OTC	България

Обща хеджираща позиция	\$532 850,44
-------------------------------	--------------

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД