



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 30.06.2011г. 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 30.06.2011г. възлиза на 59.77%.

Банковите депозити съставляват 10,51% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.06.2011г. са 27.07% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с предварително платена такса към БФБ, дивиденди и увеличение капитала на публично дружество възлизат на 2.65% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.06.2011г. е минус 1,88% на годишна база*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 11,37%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 30.06.2011г. е 12,71%.

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.

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

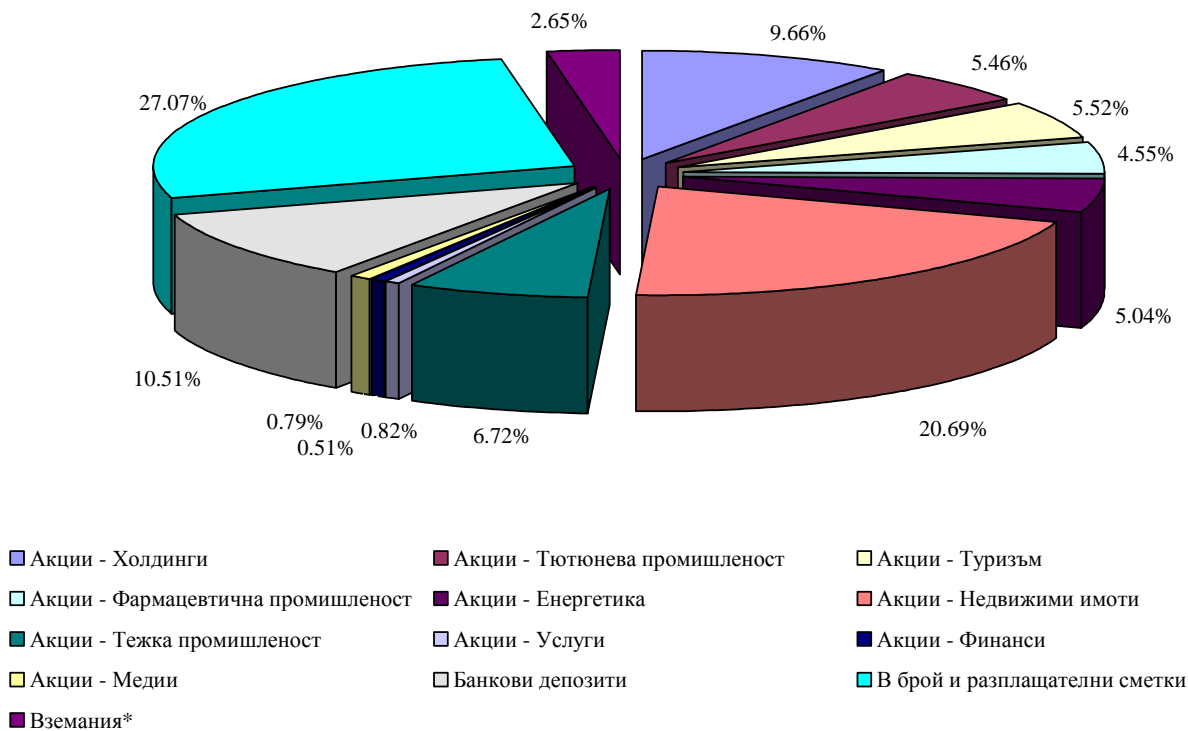


Асет Мениджмънт

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 30/06/2011		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	274 127	9.66%
Акции - Тютюнева промишленост	154 880	5.46%
Акции - Туризм	156 742	5.52%
Акции - Фармацевтична промишленост	129 205	4.55%
Акции - Енергетика	142 918	5.04%
Акции - Недвижими имоти	586 953	20.69%
Акции - Тежка промишленост	255 011	8.99%
Акции - Услуги	23 183	0.82%
Акции - Финанси	14 514	0.51%
Акции - Медии	22 554	0.79%
Банкови депозити	298 119	10.51%
В брой и разплащателни сметки	768 043	27.07%
Вземания*	10 802	0.38%
Обща сума	2 837 051	100.00%

* Вземания във връзка с предварително платена такса към БФБ, дивиденди и увеличение капитала на публично дружество

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 30/06/2011





Асет Мениджмънт

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	292 132,010	1,0000	\$292 132,01

Обща рискова позиция	\$292 132,01
----------------------	--------------

Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 199 000,00	1,462400	\$291 017,60	OTC	България

Обща хеджираща позиция	\$291 017,60
------------------------	--------------

Мирослав Маринов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД