



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 31.08.2011г. 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 31.08.2011г. възлиза на 55,26%.

Банковите депозити съставляват 11,97% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.08.2011г. са 19,76% от стойността на портфейла. Инвестициите в дългови ценни книжа към края на месеца са 11,37% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с предварително платена такса към БФБ, лихвено плащане, дивиденди и хеджиране възлизат на 1,65% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.08.2011г. е минус 2,85% на годишна база*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 12,40%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 31.08.2011г. е 1,39%.

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

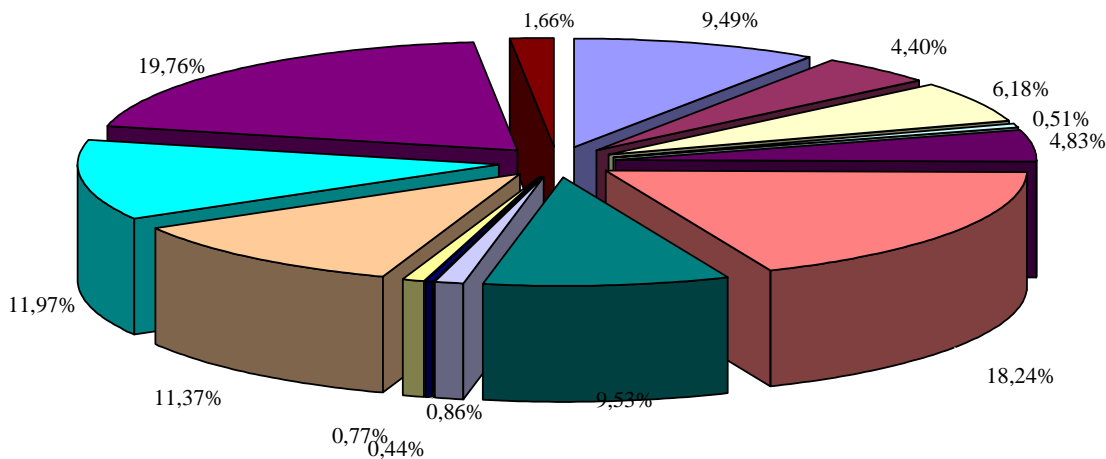
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик в края на периода е представена в следната таблица и графика.

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

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31/08/2011		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	239 149	9,49%
Акции - Тютюнева промишленост	110 959	4,40%
Акции - Туризм	155 652	6,18%
Акции - Фармацевтична промишленост	12 781	0,51%
Акции - Енергетика	121 595	4,83%
Акции - Недвижими имоти	459 777	18,24%
Акции - Тежка промишленост	240 245	9,53%
Акции - Услуги	21 718	0,86%
Акции - Финанси	11 031	0,44%
Акции - Медии	19 497	0,77%
Дългови ценни книжа	286 417	11,37%
Банкови депозити	301 592	11,97%
В брой и разплащателни сметки	497 953	19,76%
Вземания*	41 713	1,66%
Обща сума	2 520 080	100,00%

* Вземания във връзка с предварително платена такса към БФБ, лихвено плащане, дивиденди и хеджиране

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/08/2011



- Акции - Холдинги
- Акции - Тютюнева промишленост
- Акции - Туризм
- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Енергетика
- Акции - Недвижими имоти
- Акции - Тежка промишленост
- Акции - Услуги
- Акции - Финанси
- Акции - Медии
- Дългови ценни книжа
- Банкови депозити
- В брой и разплащателни сметки
- Вземания*



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	57 127,740	1,0000	\$57 127,74

Обща рискова позиция	\$57 127,74
----------------------	-------------

Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 39 000,00	1,434490	\$55 945,11	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$55 945,11		

Мирослав Маринов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД