



## 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 30.04.2011г. 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 29.04.2011г. възлиза на 63,68%.

Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 29.04.2011г. възлизат на 4,87% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 10,10% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 29.04.2011г. са 20,94% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с продажба на права, хеджиране, както и предварително платени такси към БФБ и КФН възлизат на 0,41% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.04.2011г. е минус 1,67% на годишна база\*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 10,68%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 29.04.2011г. е 5,95%.

### 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

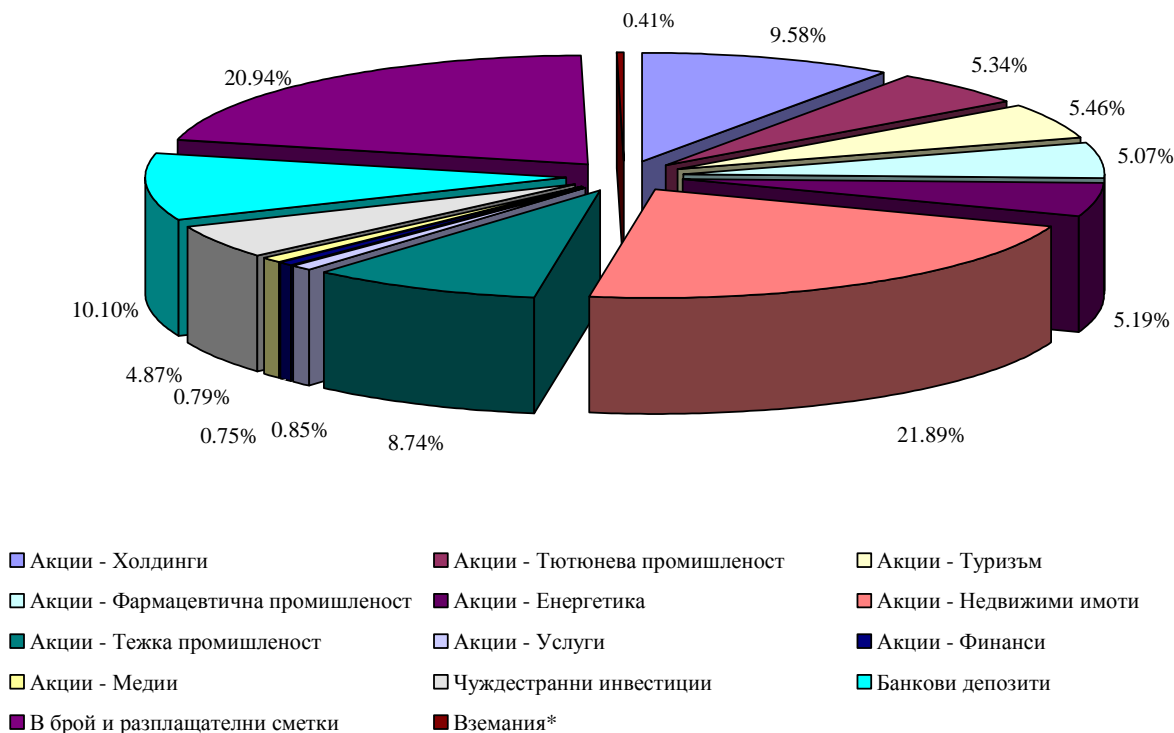
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик в края на периода е представена в следната таблица и графика.

\* 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 29/04/2011		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	279 557	9.58%
Акции - Тютюнева промишленост	155 884	5.34%
Акции - Туризм	159 128	5.46%
Акции - Фармацевтична промишленост	147 975	5.07%
Акции - Енергетика	151 488	5.19%
Акции - Недвижими имоти	638 628	21.89%
Акции - Тежка промишленост	254 996	8.74%
Акции - Услуги	24 749	0.85%
Акции - Финанси	21 904	0.75%
Акции - Медии	23 123	0.79%
Чуждестранни инвестиции	141 956	4.87%
Банкови депозити	294 633	10.10%
В брой и разплащателни сметки	610 766	20.94%
Вземания*	12 012	0.41%
Обща сума	2 916 799	100.00%

\* Вземания във връзка с продажба на права, хеджиране, както и предварително платени такси към БФБ и КФН.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 29/04/2011





# 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	5 450,000	19,7900	\$107 855,50
Валутно деноминиран актив	USD	172 142,070	1,0000	\$172 142,07

Обща рискова позиция	\$279 997,57
----------------------	--------------

Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 199 000,00	1,440700	\$286 699,30	OTC	България

Обща хеджираща позиция	\$286 699,30
------------------------	--------------

Стоян Тошев  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Мирослав Маринов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД