

**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 30.06.2010г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик са разпределени в 9 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 30.06.2010г. възлиза на 64,77%.

Корпоративните облигации в портфейла представляват 1,67% от активите на Ти Би Ай Динамик. Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 30.06.2010г. възлизат на 21,96% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 10,45% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.06.2010г. са 0,79% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с лихвено плащане, с хеджиращи операции, както и предварително платена такса на БФБ възлизат на 0,36% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.06.2010г. е минус 4,68% на годишна база\*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 15,42%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 30.06.2010г. е 1,66%, а доходността от началото на годината е минус 7,69%.

**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.

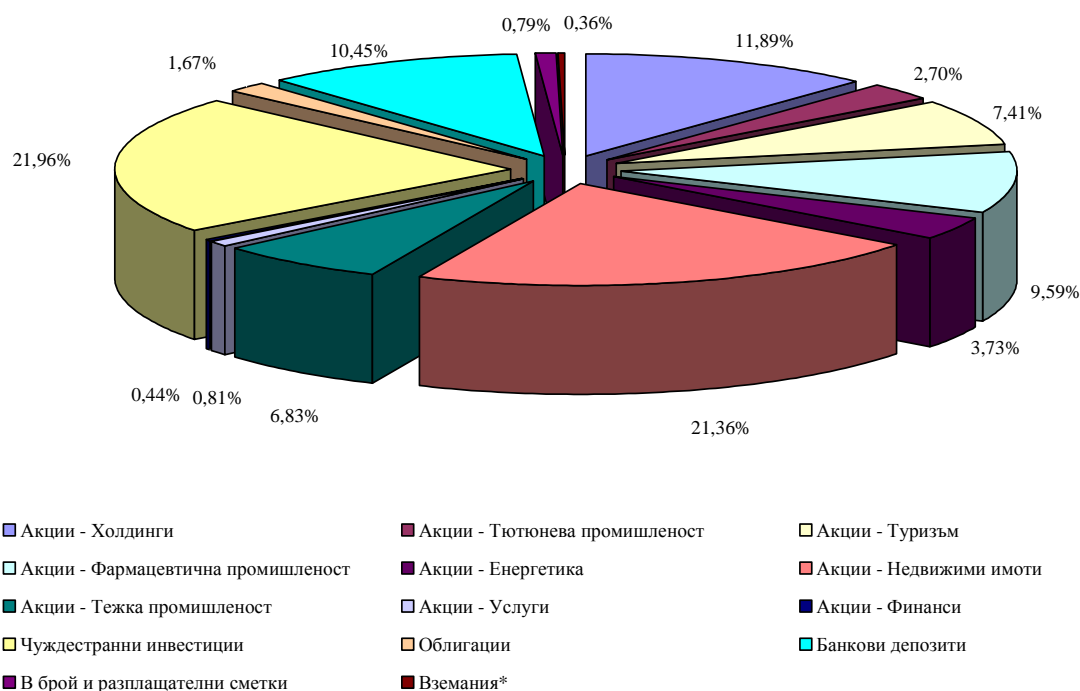
Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 30/06/2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	315 975	11,89%
Акции - Гюгюнева промишленост	71 819	2,70%
Акции - Туризъм	196 980	7,41%
Акции - Фармацевтична промишленост	254 786	9,59%
Акции - Енергетика	98 989	3,73%
Акции - Недвижими имоти	567 574	21,36%
Акции - Тежка промишленост	181 418	6,83%
Акции - Услуги	21 623	0,81%
Акции - Финанси	11 601	0,44%
Чуждестранни инвестиции	583 349	21,96%

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

Облигации	44 497	1,67%
Банкови депозити	277 688	10,45%
В брой и разплащателни сметки	20 877	0,79%
Вземания*	9 486	0,36%
Обща сума	2 656 661	100,00%

\* Вземания във връзка с лихвено плащане, с хеджиращи операции, както и предварително платена такса на БФБ

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 30/06/2010**



**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	2 790,000	19,6895	\$54 933,71
Валутно деноминиран актив	USD	2 350,000	32,9200	\$77 362,00
Валутно деноминиран актив	USD	850,000	62,8660	\$53 436,10
Валутно деноминиран актив	USD	1 450,000	40,0627	\$58 090,92
<b>Обща рискова позиция</b>				<b>\$243 822,73</b>

---

Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 233 000,00	1,202920	\$280 280,36	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$280 280,36		

Стоян Тошев  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД