

**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 31.03.2010г. 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 31.03.2010г. възлиза на 63,66%.

Корпоративните облигации в портфейла представляват 1,55% от активите на Ти Би Ай Динамик. Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 31.03.2010г. възлизат на 18,13% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 11,18% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.03.2010г. са 5,46% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с предварително платена такса на БФБ и КФН възлизат на 0,01% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.03.2010г. е минус 3,37% на годишна база\*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 13,91%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 31.03.2010г. е 30,06%, а доходността от началото на годината е минус 0,58%.

**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.

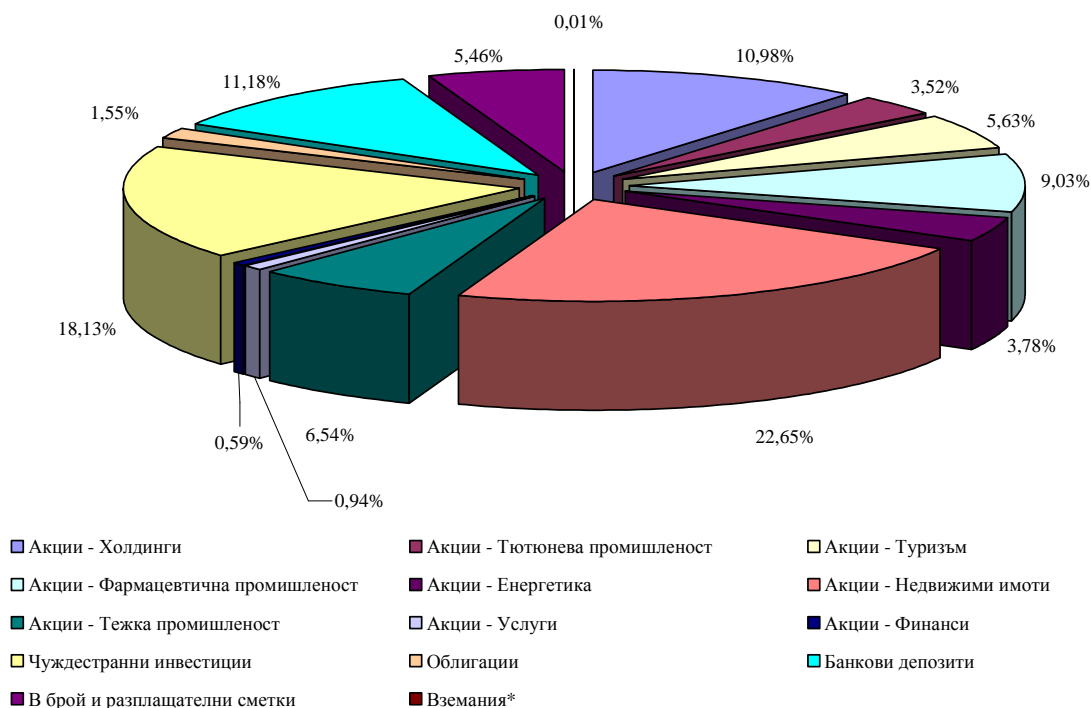
Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31/03/2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	323 673	10,98%
Акции - Тютюнева промишленост	103 838	3,52%
Акции - Туризм	165 801	5,63%
Акции - Фармацевтична промишленост	266 179	9,03%
Акции - Енергетика	111 424	3,78%
Акции - Недвижими имоти	667 326	22,65%
Акции - Тежка промишленост	192 604	6,54%
Акции - Услуги	27 646	0,94%
Акции - Финанси	17 515	0,59%
Чуждестранни инвестиции	534 327	18,13%
Облигации	45 783	1,55%
Банкови депозити	329 447	11,18%

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

В брой и разплащателни сметки	160 960	5,46%
Вземания*	165	0,01%
Обща сума	2 946 688	100,00%

\* Вземания във връзка с предварително платена такса на БФБ и КФН.

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/03/2010**



## 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.

<b>Рисков актив</b>				
<b>ISIN</b>	<b>Валута</b>	<b>Брой</b>	<b>Цена</b>	<b>Обща Стойност</b>
Валутно деноминиран актив	USD	930.000	96.1772	\$89 444.80
Валутно деноминиран актив	USD	3 446.523	23.2469	\$80 120.98
Валутно деноминиран актив	USD	2 350.000	42.2800	\$99 358.00
<b>Обща рискова позиция</b>				<b>\$268 923.77</b>

<b>Дериватен инструмент</b>						
<b>Вид</b>	<b>Валута</b>	<b>Брой</b>	<b>Цена</b>	<b>Обща Стойност</b>	<b>Пазар</b>	<b>Държава</b>
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 105 000.00	1.365120	\$143 337.60	OTC	България
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 90 000.00	1.353765	\$121 838.85	OTC	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>				<b>\$265 176.45</b>		

Стоян Тошев  
 Изпълнителен директор  
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД