

**ИНФОРМАЦИЯ,  
СЪГЛАСНО ЧЛ. 48 ОТНАРЕДБА № 25 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА  
ИНВЕСТИЦИОННИТЕ ДРУЖЕСТВА И ДОГОВОРНИ ФОНДОВЕ**

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 30.10.2009г. акциите на български компании в портфейла на Фонда са разпределени в 11 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 30.10.2009г. възлиза на 64,65%.

Корпоративните облигации в портфейла представляват 1,27% от активите на Ти Би Ай Динамик. Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 30.10.2009г. възлизат на 9,54% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 22,98% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.10.2009г. са 0,31% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с предварително платени такси на БФБ, ЦД и КФН, както и вземания от дивиденди възлизат на 1,26% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.10.2009г. е минус 3,03% на годишна база\*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 13,50%. А доходността на Фонда от началото на тази година до 30.10.2009г. е 5,24%.

## **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.

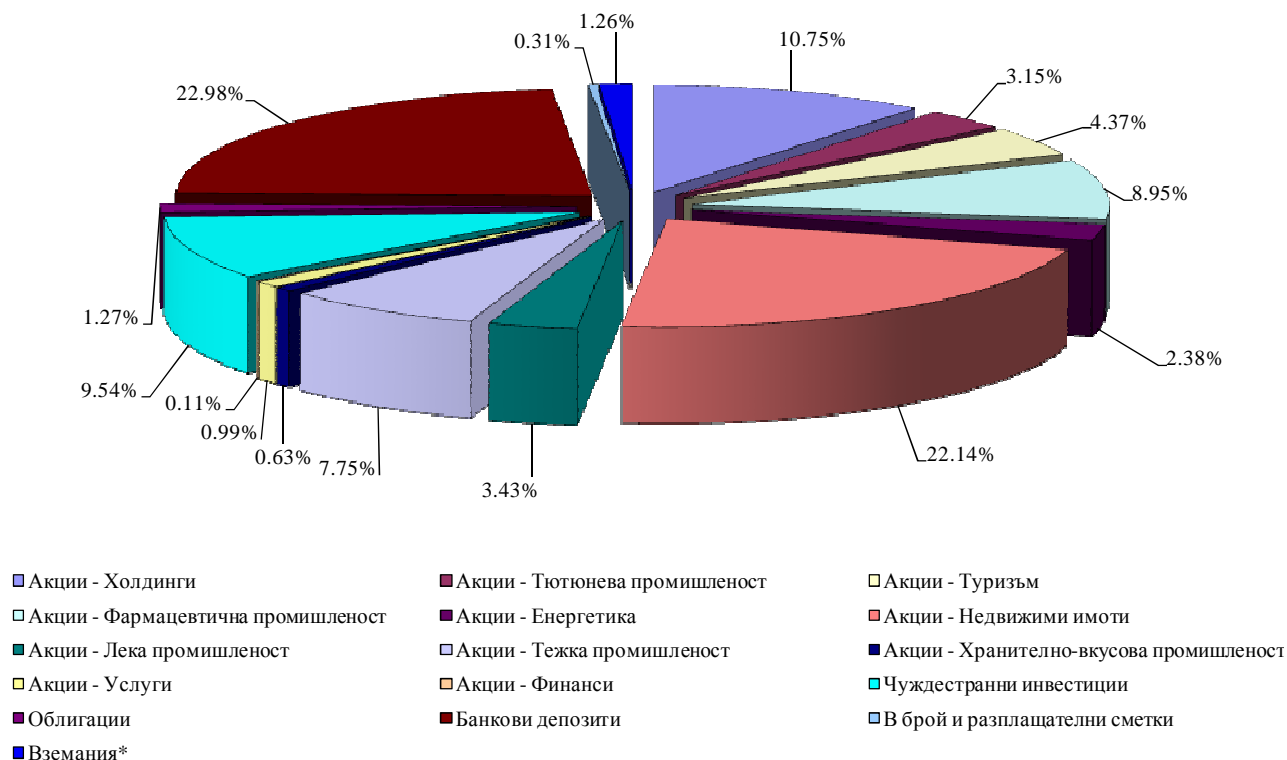
<b>Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 30/10/2009</b>		
<b>Актив</b>	<b>Стойност в лева</b>	<b>Процент от активите</b>
Акции - Холдинги	369 669	10,75%
Акции - Тютюнева промишленост	108 217	3,15%
Акции - Туризъм	150 163	4,37%
Акции - Фармацевтична промишленост	307 747	8,95%
Акции - Енергетика	81 948	2,38%
Акции - Недвижими имоти	761 348	22,14%
Акции - Лека промишленост	118 009	3,43%
Акции - Тежка промишленост	266 365	7,75%
Акции - Хранително-вкусова промишленост	21 821	0,63%
Акции - Услуги	34 057	0,99%
Акции - Финанси	3 633	0,11%
Чуждестранни инвестиции	328 163	9,54%
Облигации	43 500	1,27%
Банкови депозити	790 057	22,98%
В брой и разплащателни сметки	10 530	0,31%
Вземания*	43 221	1,26%

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

Обща сума	3 438 447	100,00%
-----------	-----------	---------

\* Вземания от дивиденди и предварително платени такси на БФБ, ЦД и КФН

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 30/10/2009**



**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	930,000	77,436	\$72 015,48
Валутно деноминиран актив	USD	3 446,523	22,3559	\$77 050,12
<b>Обща рискова позиция</b>				<b>\$149 065,60</b>

**Дериватен инструмент**

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 110 000,00	1,49075	\$163 982,50	OTC	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>				<b>\$163 982,50</b>		

Стоян Тошев  
 Изпълнителен директор  
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД