

**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 31.05.2010г. 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 31.05.2010г. възлиза на 62,61%.

Корпоративните облигации в портфейла представляват 1,58% от активите на Ти Би Ай Динамик. Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 31.05.2010г. възлизат на 19,91% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 10,84% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.05.2010г. са 5,05% от стойността на портфейла.

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

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.05.2010г. е минус 4,51% на годишна база*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 15,25%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 31.05.2010г. е 4,42%, а доходността от началото на годината е минус 6,56%.

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

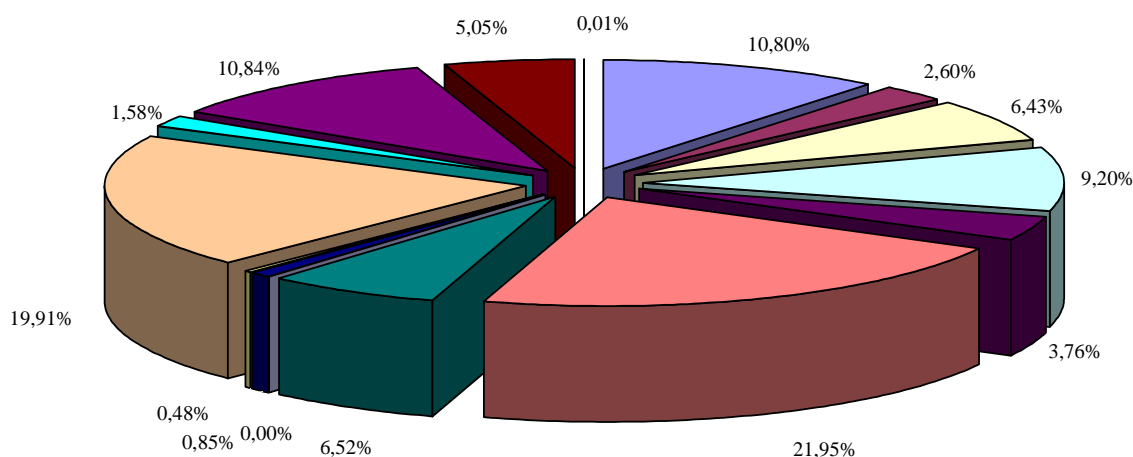
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик в края на периода е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31/05/2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	302 784	10,80%
Акции - Тютюнева промишленост	72 804	2,60%
Акции - Туризм	180 302	6,43%
Акции - Фармацевтична промишленост	257 864	9,20%
Акции - Енергетика	105 418	3,76%
Акции - Недвижими имоти	615 110	21,95%
Акции - Тежка промишленост	182 822	6,52%
Акции - Химическа промишленост	82	0,00%
Акции - Услуги	23 924	0,85%
Акции - Финанси	13 532	0,48%
Чуждестранни инвестиции	558 121	19,91%

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

Облигации	44 213	1,58%
Банкови депозити	303 702	10,84%
В брой и разплащателни сметки	141 577	5,05%
Вземания*	290	0,01%
Обща сума	2 802 544	100,00%

* Вземания във връзка с лихвено плащане, както и предварително платена такса на БФБ, ЦД и КФН.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/05/2010


- Акции - Холдинги
- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Тежка промишленост
- Акции - Финанси
- Банкови депозити
- Акции - Тютюнева промишленост
- Акции - Енергетика
- Акции - Химическа промишленост
- Чуждестранни инвестиции
- В брой и разплащателни сметки
- Акции - Туризм
- Акции - Недвижими имоти
- Акции - Услуги
- Облигации
- Вземания*

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	24,1151	\$67 281,13
Валутно деноминиран актив	USD	2 350,000	36,2500	\$85 187,50
Валутно деноминиран актив	USD	850,000	63,7021	\$54 146,78
Валутно деноминиран актив	USD	1 450,000	39,5872	\$57 401,44
Обща рискова позиция				\$264 016,85

Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 215 000,00	1,269830	\$273 013,45	OTC	България
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 18 000,00	1,242380	\$22 362,84	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$295 376,29		

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД