



# Асет Мениджмънт

## 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 31.03.2011г. 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 31.03.2011г. възлиза на 62,18%.

Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 31.03.2011г. възлизат на 5,31% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 9,94% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.03.2011г. са 21,51% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с увеличение капитала на дружество, хеджиране, както и предварително платени такси към БФБ и КФН възлизат на 1,07% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.03.2011г. е минус 1,62% на годишна база\*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 10,67%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 31.03.2011г. е 6,77%.

### 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.

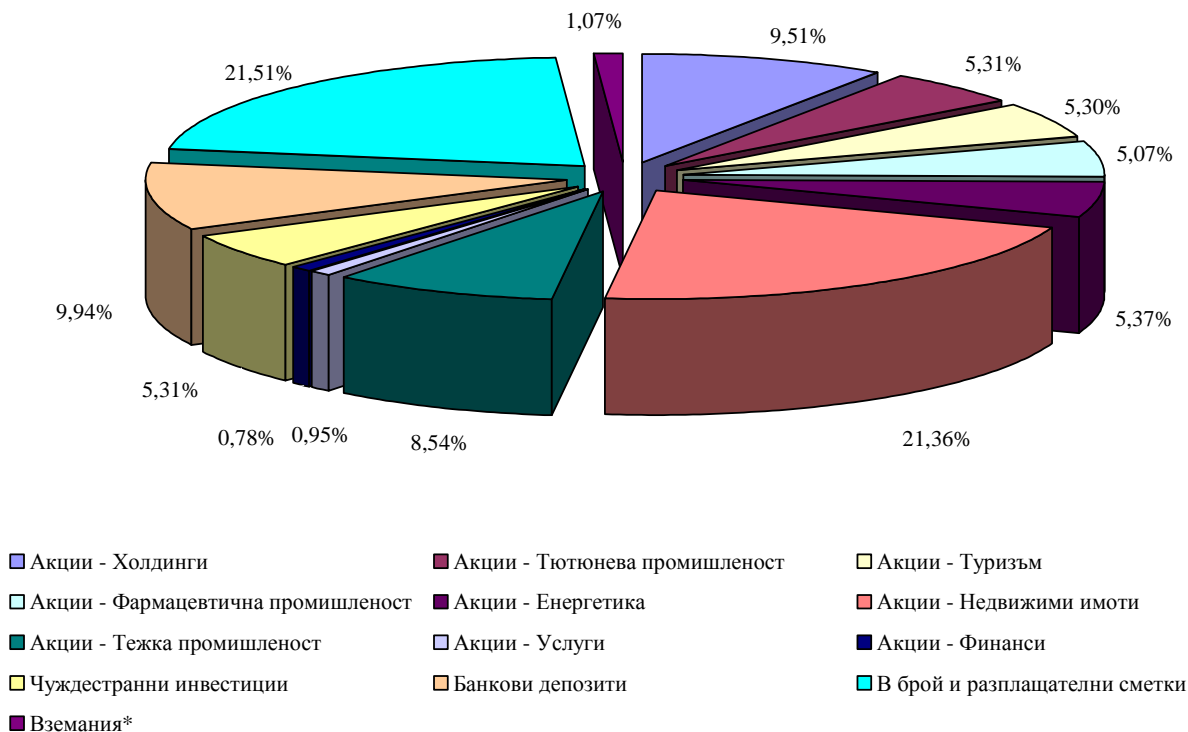


# Асет Мениджмънт

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31/03/2011		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	280 335	9,51%
Акции - Тютюнева промишленост	156 437	5,31%
Акции - Туризм	156 275	5,30%
Акции - Фармацевтична промишленост	149 365	5,07%
Акции - Енергетика	158 257	5,37%
Акции - Недвижими имоти	629 534	21,36%
Акции - Тежка промишленост	251 821	8,54%
Акции - Услуги	27 908	0,95%
Акции - Финанси	22 942	0,78%
Чуждестранни инвестиции	156 509	5,31%
Банкови депозити	292 992	9,94%
В брой и разплащателни сметки	634 040	21,51%
Вземания*	31 484	1,07%
Обща сума	2 947 900	100,00%

\* Вземания във връзка с увеличение капитала на дружество, хеджиране, както и предварително платени такси към БФБ и КФН.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/03/2011



## 2) Данни по чл. 48, ал. 3, т. 2 от Наредба № 25



# Асет Мениджмънт

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	20,8600	\$113 687,00
Валутно деноминиран актив	USD	172 146,450	1,0000	\$172 146,45

<b>Обща рискова позиция</b>	<b>\$285 833,45</b>
-----------------------------	---------------------

Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 217 000,00	1,382950	\$300 100,15	OTC	България

<b>Обща хеджираща позиция</b>	<b>\$300 100,15</b>
-------------------------------	---------------------

Стоян Тошев  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Мирослав Маринов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД