



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 30.12.2010г. 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 30.12.2010г . възлиза на 60,89%.

Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 30.12.2010г . възлизат на 20,39% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 10,34% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.12.2010г . са 8,37% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с дивиденди възлизат на 0,01% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.12.2010г . е минус 2,79% на годишна база*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 14,54%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 30.12.2010г . е 0,001%.

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 30/12/2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	299 401	10,75%
Акции - Тютюнева промишленост	147 823	5,31%
Акции - Туризм	129 090	4,64%
Акции - Фармацевтична промишленост	172 891	6,21%
Акции - Енергетика	98 426	3,53%
Акции - Недвижими имоти	613 683	22,04%
Акции - Тежка промишленост	199 738	7,17%
Акции - Услуги	23 443	0,84%
Акции - Финанси	11 197	0,40%
Чуждестранни инвестиции	567 990	20,39%

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

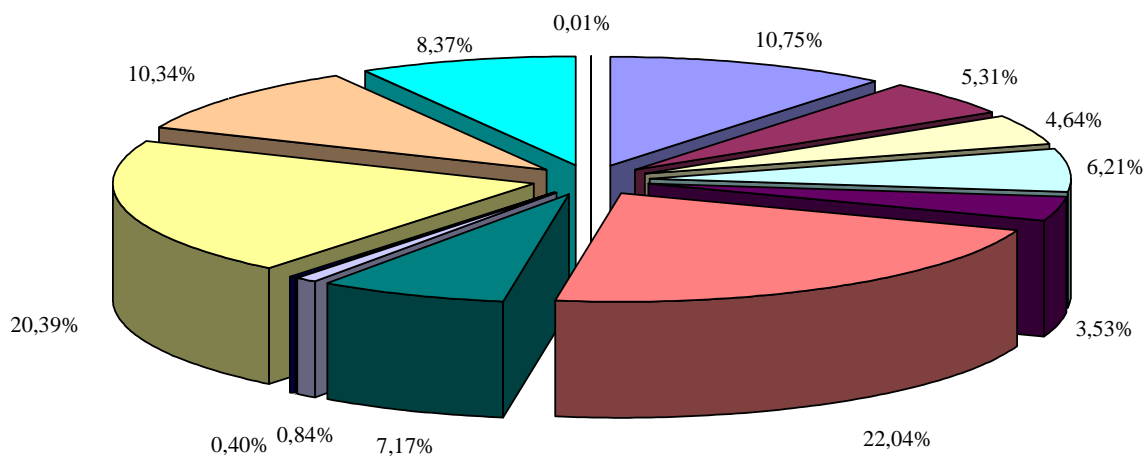


Асет Мениджмънт

Банкови депозити	287 953	10,34%
В брой и разплащателни сметки	233 140	8,37%
Вземания*	174	0,01%
Обща сума	2 784 949	100,00%

* Вземания във връзка с дивиденди

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 30/12/2010



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

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.



Асет Мениджмънт

Рисков актив				
ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
Валутно деноминиран актив	USD	2790.000	27.9311	\$77 927.77
Валутно деноминиран актив	USD	850.000	73.9487	\$62 856.40
Валутно деноминиран актив	USD	1450.000	42.6027	\$61 773.92
Валутно деноминиран актив	USD	3 650.000	23.7400	\$86 651.00
Валутно деноминиран актив	USD	3381.360	1.0000	\$3 381.36

Обща рискова позиция	\$292 590.44
-----------------------------	---------------------

Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 227 000.00	1.329490	\$301 794.23	OTC	България

Обща хеджираща позиция	\$301 794.23
-------------------------------	---------------------

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Мирослав Маринов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД