



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 31.05.2011г. 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 31.05.2011г. възлиза на 63,11%.

Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 31.05.2011г. възлизат на 5,31% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 10,36% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.05.2011г. са 21,18% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с дивиденди, продажба на права, както и предварително платени такси към БФБ и КФН възлизат на 0,03% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.05.2011г. е минус 1,84% на годишна база*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 10,89%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 31.05.2011г. е 11,81%.

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.

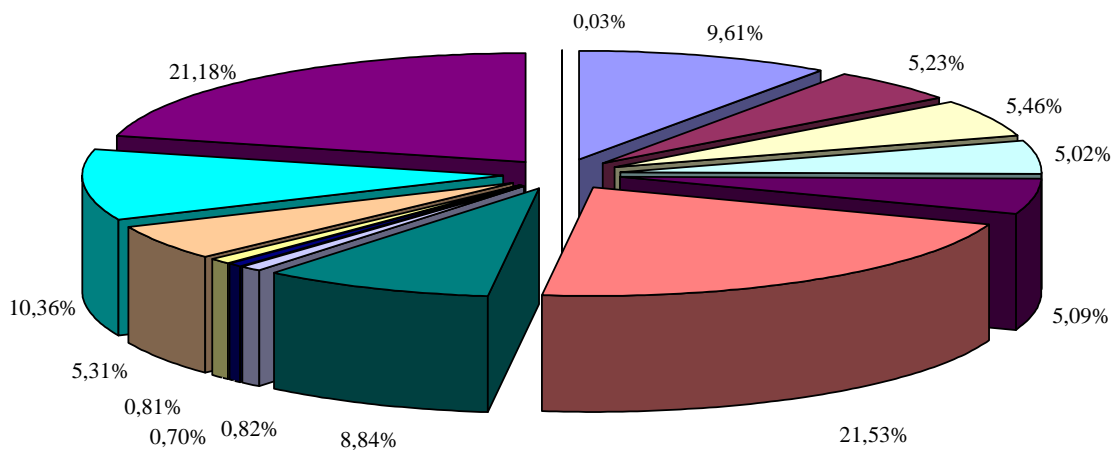


Асет Мениджмънт

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31/05/2011		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	275 071	9,61%
Акции - Тютюнева промишленост	149 633	5,23%
Акции - Туризм	156 068	5,46%
Акции - Фармацевтична промишленост	143 704	5,02%
Акции - Енергетика	145 733	5,09%
Акции - Недвижими имоти	615 871	21,53%
Акции - Тежка промишленост	252 904	8,84%
Акции - Услуги	23 393	0,82%
Акции - Финанси	20 100	0,70%
Акции - Медии	23 129	0,81%
Чуждестранни инвестиции	152 053	5,31%
Банкови депозити	296 405	10,36%
В брой и разплащателни сметки	605 909	21,18%
Вземания*	910	0,03%
Обща сума	2 860 883	100,00%

* Вземания във връзка с дивиденди, продажба на права, както и предварително платени такси към БФБ и КФН.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/05/2011



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



Асет Мениджмънт

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	5 450,000	20,5200	\$111 834,00
Валутно деноминиран актив	USD	172 137,800	1,0000	\$172 137,80

Обща рискова позиция	\$283 971,80
----------------------	--------------

Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 199 000,00	1,438600	\$286 281,40	OTC	България

Обща хеджираща позиция	\$286 281,40
------------------------	--------------

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Мирослав Маринов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД