

**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 30.07.2010г. 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 30.07.2010г. възлиза на 63,91%.

Корпоративните облигации в портфейла представляват 1,65% от активите на Ти Би Ай Динамик. Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 30.07.2010г. възлизат на 20,03% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 10,27% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.07.2010г. са 2,97% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с начислени дивиденди, лихвено плащане, хеджиращи операции, както и предварително платена такса на БФБ и ЦД възлизат на 1,17% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.07.2010г. е минус 4,03% на годишна база\*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 15,32%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 30.07.2010г. е 5,22%, а доходността от началото на годината е минус 4,97%.

**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.

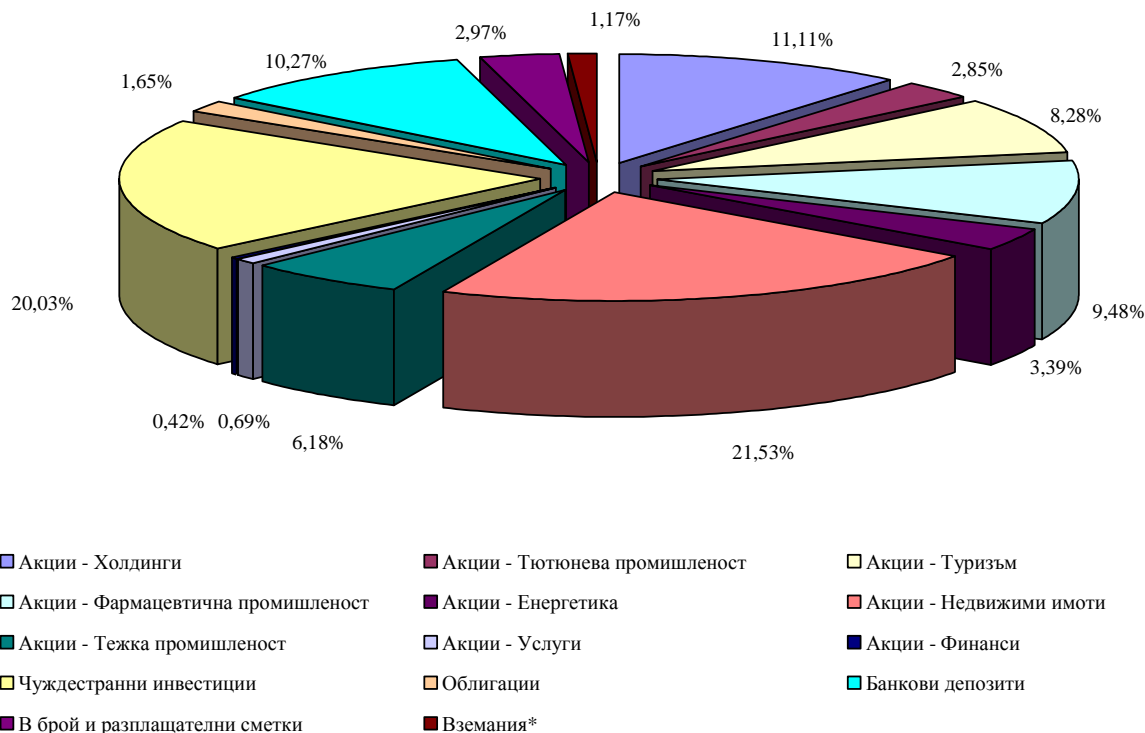
<b>Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31/07/2010</b>		
<b>Актив</b>	<b>Стойност в лева</b>	<b>Процент от активите</b>
Акции - Холдинги	302 622	11,11%
Акции - Тютюнева промишленост	77 518	2,85%
Акции - Туризм	225 461	8,28%
Акции - Фармацевтична промишленост	258 176	9,48%
Акции - Енергетика	92 245	3,39%
Акции - Недвижими имоти	586 496	21,53%
Акции - Тежка промишленост	168 321	6,18%

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

Акции - Услуги	18 706	0,69%
Акции - Финанси	11 471	0,42%
Чуждестранни инвестиции	545 727	20,03%
Облигации	44 817	1,65%
Банкови депозити	279 745	10,27%
В брой и разплащателни сметки	80 941	2,97%
Вземания*	31 982	1,17%
Обща сума	2 724 227	100,00%

\* Вземания във връзка с начислени дивиденди, лихвено плащане, хеджиращи операции, както и предварително платена такса на БФБ и ЦД

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/07/2010**



**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	22,6006	\$63 055,67
Валутно деноминиран актив	USD	2 350,000	36,7700	\$86 409,50
Валутно деноминиран актив	USD	850,000	69,8515	\$59 373,78

Валутно деноминиран актив	USD	1 450,000	41,0298	\$59 493,21
<b>Обща рискова позиция</b>				<b>\$268 332,16</b>

<b>Дериватен инструмент</b>						
<b>Вид</b>	<b>Валута</b>	<b>Брой</b>	<b>Цена</b>	<b>Обща Стойност</b>	<b>Пазар</b>	<b>Държава</b>
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 208 000,00	1,256880	\$261 431,04	OTC	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>				<b>\$261 431,04</b>		

Стоян Тошев  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД