



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 30.09.2010г. 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 30.09.2010г. възлиза на 65.36%.

Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 30.09.2010г. възлизат на 19.16% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 9.96% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.09.2010г. са 4.16% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с дивиденди, лихвено плащане, както и предварително платена такса на БФБ и ЦД възлизат на 1.36% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.09.2010г. е минус 3,06% на годишна база*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 14.08%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 30.09.2010г. е минус 5.23%, а доходността от началото на годината е минус 0.72%.

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 30/09/2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	331 121	11.66%
Акции - Тютюнева промишленост	98 808	3.48%
Акции - Туризъм	251 658	8.86%
Акции - Фармацевтична промишленост	262 768	9.25%
Акции - Енергетика	99 351	3.50%
Акции - Недвижими имоти	592 185	20.85%
Акции - Тежка промишленост	191 628	6.75%
Акции - Услуги	17 528	0.62%
Акции - Финанси	11 809	0.42%
Чуждестранни инвестиции	544 245	19.16%
Банкови депозити	283 000	9.96%

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

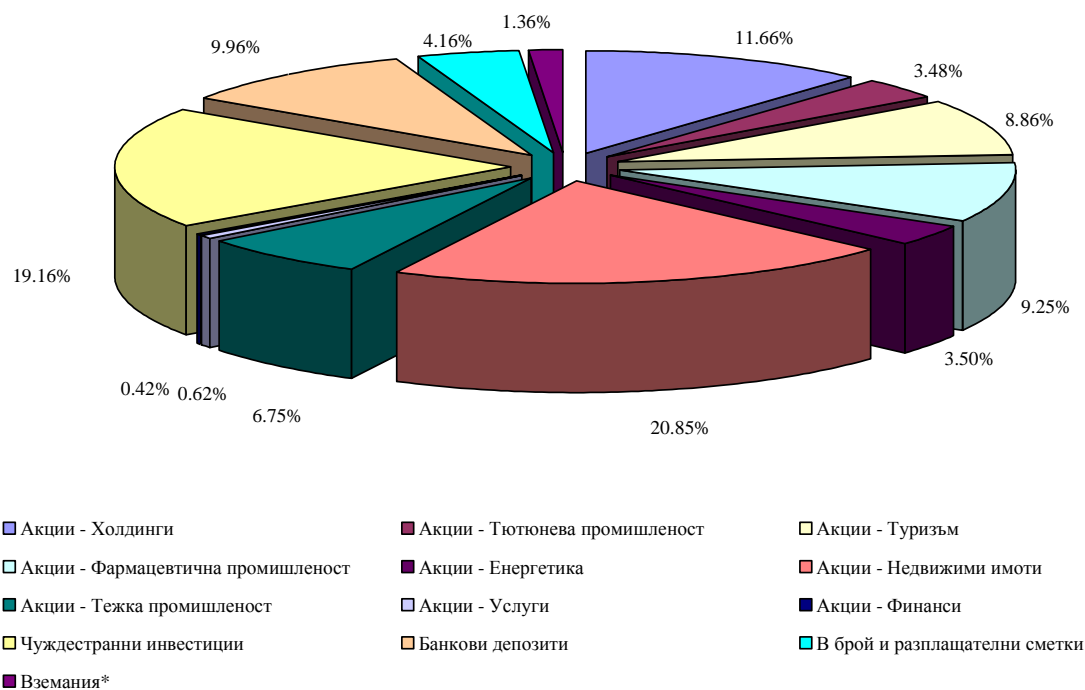


Асет Менѝжмънт

В брой и разплащателни сметки	118 100	4.16%
Вземания*	38 681	1.36%
Обща сума	2 840 882	100.00%

* Вземания във връзка с дивиденди, лихвено плащане, хеджираща сделка, както и предварително платена такса на БФБ и КФН

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 30/09/2010



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.



Асет Мениджмънт

Рисков актив				
ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
Валутно деноминиран актив	USD	2790.000	21.3391	\$59 536.09
Валутно деноминиран актив	USD	2350.000	39.6200	\$93 107.00
Валутно деноминиран актив	USD	850.000	74.6299	\$63 435.42
Валутно деноминиран актив	USD	1450.000	42.8949	\$62 197.61
Обща рискова позиция				\$278 276.11

Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 215 000.00	1.268010	\$272 622.15	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$272 622.15		

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД