



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 30.11.2010г. 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 30.11.2010г. възлиза на 63,12%.

Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 30.11.2010г. възлизат на 20,87% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 10,40% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.11.2010г. са 5,61% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с предварително платени такси на БФБ, КФН и ЦД възлизат на 0,03% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.11.2010г. е минус 3,51% на годишна база*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 15,03%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 30.11.2010г. е минус 4,39%, а доходността от началото на годината е минус 3,56%.

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 30/11/2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	309 764	11,26%
Акции - Тютюнева промишленост	135 734	4,93%
Акции - Туризм	190 198	6,91%
Акции - Фармацевтична промишленост	260 369	9,46%
Акции - Енергетика	92 872	3,37%
Акции - Недвижими имоти	533 372	19,38%
Акции - Тежка промишленост	188 594	6,85%
Акции - Услуги	16 247	0,59%
Акции - Финанси	9 925	0,36%

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

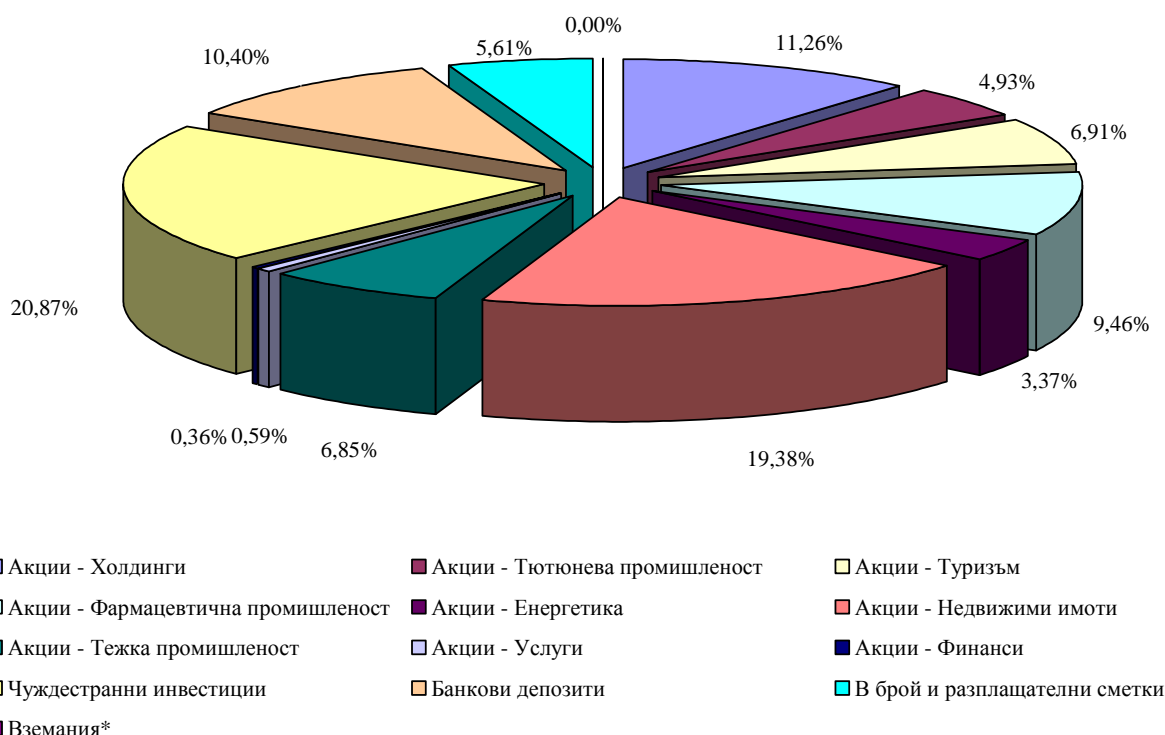


Асет Мениджмънт

Чуждестранни инвестиции	574 285	20,87%
Банкови депозити	286 297	10,40%
В брой и разплащателни сметки	154 344	5,61%
Вземания*	87	0,00%
Обща сума	2 752 089	100,00%

* Вземания във връзка с предварително платени такси на БФБ, ЦД и КФН

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 30/11/2010



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
Парични средства във валута	USD	1825.290	1.0000	\$1 825.29
Валутно деноминиран актив	USD	2790.000	21.8486	\$60 957.59
Валутно деноминиран актив	USD	850.000	73.2427	\$62 256.30
Валутно деноминиран актив	USD	1450.000	43.9481	\$63 724.75
Валутно деноминиран актив	USD	3650.000	26.8700	\$98 075.50

Обща рискова позиция	\$286 839.42
-----------------------------	--------------

Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 227 000,00	1,378780	\$312 983,06	OTC	България

Обща хеджираща позиция	\$312 983,06
-------------------------------	--------------

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД