

## ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО ЧЛ. 48 ОТНАРЕДБА № 25 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА ИНВЕСТИЦИОННИТЕ ДРУЖЕСТВА И ДОГОВОРНИ ФОНДОВЕ

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 26.02.2010г. 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 26.02.2010г. възлиза на 61,90%.

Корпоративните облигации в портфейла представляват 1,43% от активите на Ти Би Ай Динамик. Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 26.02.2010г. възлизат на 18,56% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 16,00% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 26.02.2010г. са 0,83% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с предварително платена такса на БФБ и ЦД, както и вземания във връзка с увеличение на капитала на дружество възлизат на 1,27% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 26.02.2010г. е минус 3,85% на годишна база\*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 14,07%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 26.02.2010г. е 25,98%, а доходността от началото на годината е минус 2,47%.

### 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

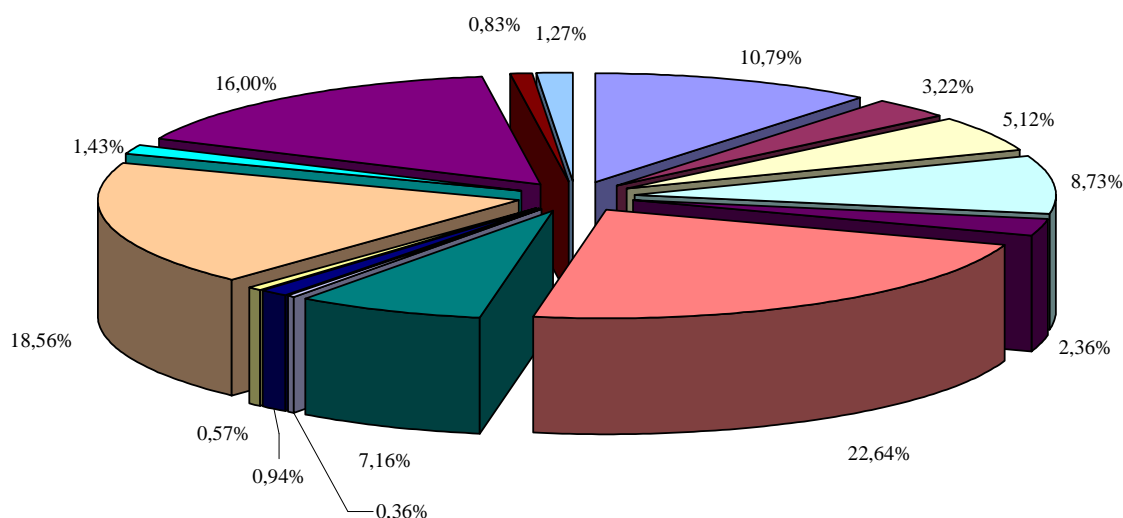
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик в края на периода е представена в следната таблица и графика.

<b>Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 26/02/2010</b>		
<b>Актив</b>	<b>Стойност в лева</b>	<b>Процент от активите</b>
Акции - Холдинги	335 332	10,79%
Акции - Тютюнева промишленост	100 054	3,22%
Акции - Туризм	159 035	5,12%
Акции - Фармацевтична промишленост	271 378	8,73%
Акции - Енергетика	73 454	2,36%
Акции - Недвижими имоти	703 515	22,64%
Акции - Тежка промишленост	222 521	7,16%
Акции - Хранително-вкусова промишленост	11 297	0,36%
Акции - Услуги	29 169	0,94%
Акции - Финанси	17 802	0,57%
Чуждестранни инвестиции	576 748	18,56%
Облигации	44 524	1,43%
Банкови депозити	497 313	16,00%
В брой и разплащателни сметки	25 784	0,83%
Вземания*	39 417	1,27%

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

Обща сума	3 107 344	100,00%
* Вземания във връзка с предварително платена такса на БФБ и ЦД, както и вземания във връзка с увеличение на капитала на дружество		

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 26/02/2010**



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

**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	930	74.0133	\$68 832.37
Валутно деноминиран актив	USD	3 446.523	21.6078	\$74 471.78
<b>Обща рискова позиция</b>				<b>\$143 304.15</b>

Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 105 000	1.376155	\$144 496.28	OTC	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>				<b>\$144 496.28</b>		

Стоян Тошев  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД