



# 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 28.02.2011г. 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 28.02.2011г възлиза на 62,27%.

Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 28.02.2011г възлизат на 17,45% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 9,90% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 28.02.2011г са 10,20% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с хеджиране, както и предварително платени такси към БФБ и ЦД възлизат на 0,17% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 28.02.2011г. е минус 1,82% на годишна база\*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 10,67%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 28.02.2011г е 7,76%.

### 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.

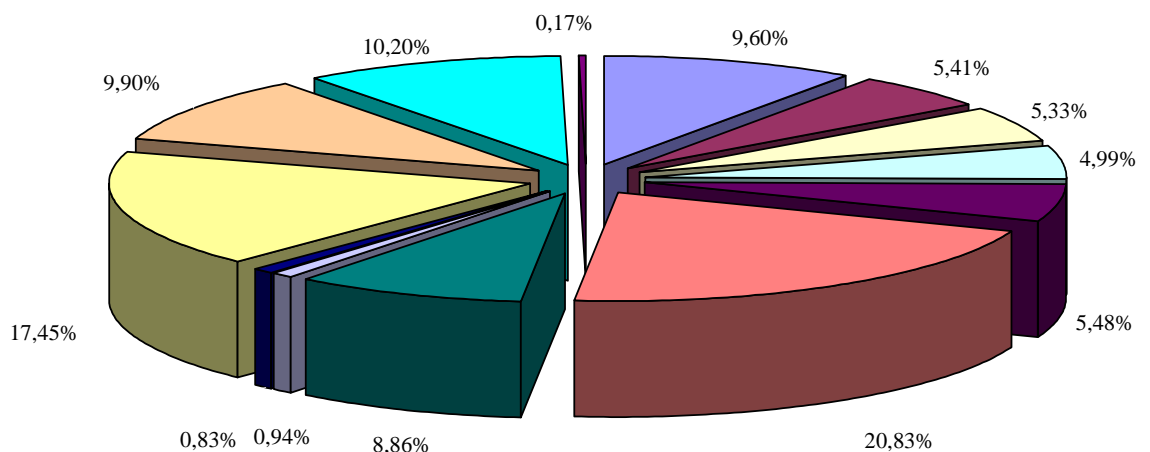


# Асет Мениджмънт

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 28/02/2011		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	282 352	9,60%
Акции - Тютюнева промишленост	159 187	5,41%
Акции - Туризм	156 669	5,33%
Акции - Фармацевтична промишленост	146 849	4,99%
Акции - Енергетика	161 109	5,48%
Акции - Недвижими имоти	612 520	20,83%
Акции - Тежка промишленост	260 402	8,86%
Акции - Услуги	27 501	0,94%
Акции - Финанси	24 393	0,83%
Чуждестранни инвестиции	513 139	17,45%
Банкови депозити	291 195	9,90%
В брой и разплащателни сметки	299 876	10,20%
Вземания*	5 088	0,17%
Обща сума	2 940 279	100,00%

\* Вземания във връзка с хеджиране, както и предварително платени такси към БФБ и ЦД

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 28/02/2011



- Акции - Холдинги
- Акции - Тютюнева промишленост
- Акции - Туризм
- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Енергетика
- Акции - Недвижими имоти
- Акции - Тежка промишленост
- Акции - Услуги
- Акции - Финанси
- 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	850.000	73.4577	\$62 439.05
Валутно деноминиран актив	USD	1 450.000	41.5821	\$60 294.05
Валутно деноминиран актив	USD	3 650.000	21.3500	\$77 927.50
Валутно деноминиран актив	USD	85 134.780	1.0000	\$85 134.78

Обща рискова позиция	\$285 795.37
----------------------	--------------

Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 217 000.00	1.367310	\$296 706.27	OTC	България

Обща хеджираща позиция	\$296 706.27
------------------------	--------------

Стоян Тошев  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Мирослав Маринов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД