



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 29.10.2010г. 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 29.10.2010г. възлиза на 65.64%.

Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 29.10.2010г. възлизат на 9.66% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 10,16% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 29.10.2010г. са 14.50% от стойността на портфейла.

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

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.10.2010г. е минус 3,12% на годишна база*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 15.34%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 29.10.2010г. е минус 3,34%, а доходността от началото на годината е минус 1,27%.

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.

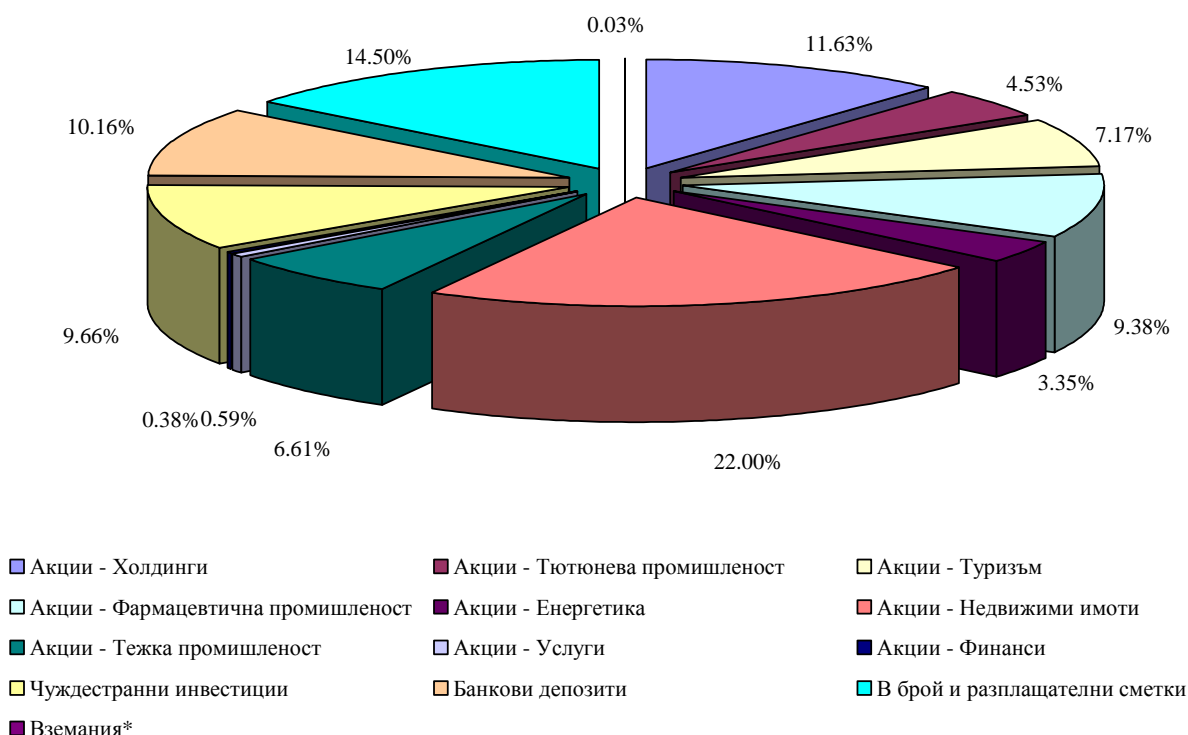
Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 29/10/2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	325 697	11,63%
Акции - Тютюнева промишленост	127 006	4,53%
Акции - Туризм	200 732	7,17%
Акции - Фармацевтична промишленост	262 836	9,38%
Акции - Енергетика	93 743	3,35%
Акции - Недвижими имоти	616 327	22,00%
Акции - Тежка промишленост	185 016	6,61%
Акции - Услуги	16 462	0,59%
Акции - Финанси	10 724	0,38%

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

Чуждестранни инвестиции	270 696	9,66%
Банкови депозити	284 585	10,16%
В брой и разплащателни сметки	406 226	14,50%
Вземания*	899	0,03%
Обща сума	2 800 949	100,00%

* Вземания във връзка с дивиденди, лихвено плащане, както и предварително платени такси на БФБ, ЦД и КФН

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 29/10/2010



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	94 812.94	1.000	\$94 812.94
Валутно деноминиран актив	USD	2 790.00	22.2368	\$62 040.67
Валутно деноминиран актив	USD	850.00	75.5442	\$64 212.57
Валутно деноминиран актив	USD	1 450.00	45.1959	\$65 534.06
Обща рискова позиция				\$286 600.24

Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 207 000.00	1.396710	\$289 118.97	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$289 118.97		

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД