



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 29.07.2011г. 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 29.07.2011г. възлиза на 62,02%.

Банковите депозити съставляват 11,09% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 29.07.2011г. са 7,67% от стойността на портфейла. Чуждестранните инвестиции към края на месеца възлизат на 6,19% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик, докато инвестициите в дългови ценни книжа са 10,68% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с предварително платена такса към БФБ, дивиденди и увеличение капитала на публично дружество възлизат на 2,36% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.07.2011г. е минус 2,01% на годишна база*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 11,12%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 29.07.2011г. е 8,56%.

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.

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

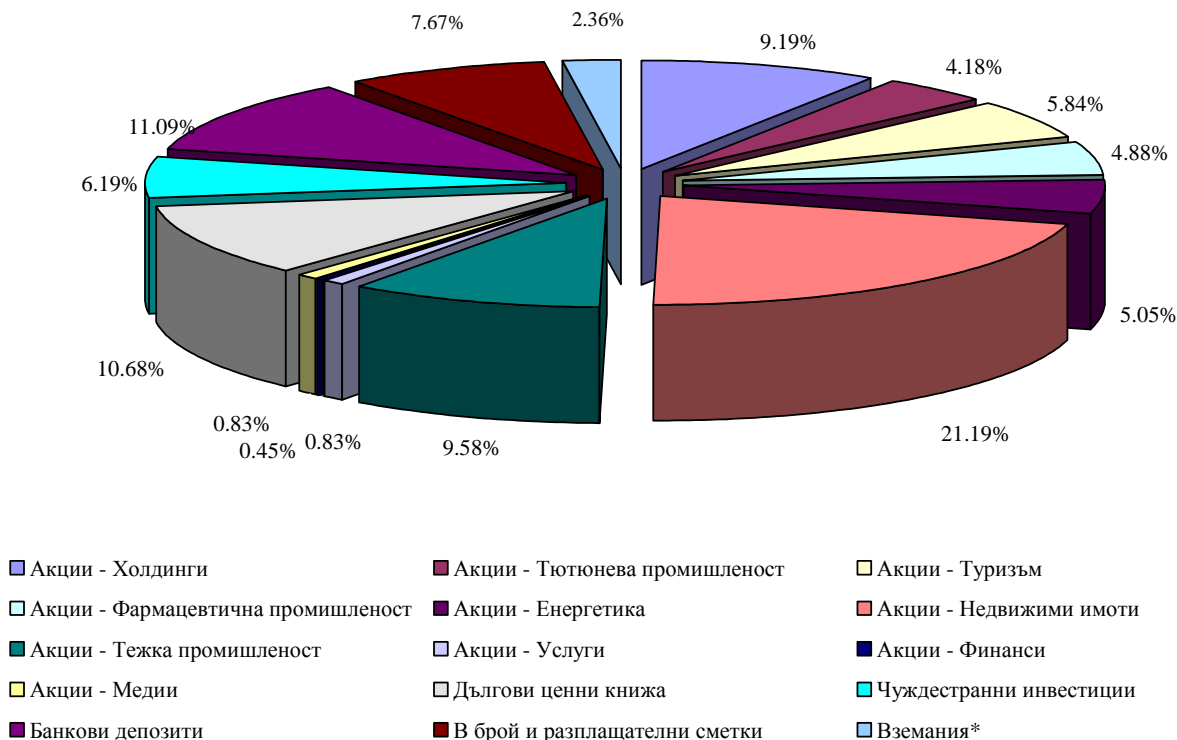


Асет Мениджмънт

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 29/07/2011		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	248 454	9.19%
Акции - Тютюнева промишленост	113 034	4.18%
Акции - Туризм	157 996	5.84%
Акции - Фармацевтична промишленост	131 953	4.88%
Акции - Енергетика	136 462	5.05%
Акции - Недвижими имоти	572 909	21.19%
Акции - Тежка промишленост	258 898	9.58%
Акции - Услуги	22 311	0.83%
Акции - Финанси	12 266	0.45%
Акции - Медии	22 441	0.83%
Дългови ценни книжа	288 842	10.68%
Чуждестранни инвестиции	167 262	6.19%
Банкови депозити	299 789	11.09%
В брой и разплащателни сметки	207 288	7.67%
Вземания*	63 803	2.36%
Обща сума	2 703 709	100.00%

* Вземания във връзка с предварително платена такса към БФБ, дивиденди и увеличение капитала на публично дружество

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 29/07/2011





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	57 127,740	1,0000	\$57 127,74

Обща рискова позиция	\$57 127,74
----------------------	-------------

Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 199 000.00	1.414390	\$281 463.61	OTC	България
Форуърд продава EUR/USD	EUR/USD	€ 160 000.00	1.405100	\$224 816.00		
Обща хеджираща позиция				\$56 647.61		

Мирослав Маринов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД