



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 30.09.2011г. 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 30.09.2011г. възлиза на 56,11%.

Банковите депозити съставляват 12,19% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.09.2011г. са 8,44% от стойността на портфейла. Инвестициите в дългови ценни книжа към края на месеца са 18,46% от стойността на портфейла. През месеца са закупени чуждестранни инвестиции, които представляват 4,50% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Вземанията във връзка с предварително платена такса към БФБ и КФН, както и вземания от дивиденди и от продажба на права възлизат на 0,31% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.09.2011г. е минус 2,89% на годишна база*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 13,48%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 30.09.2011г. е минус 2,03%.

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.

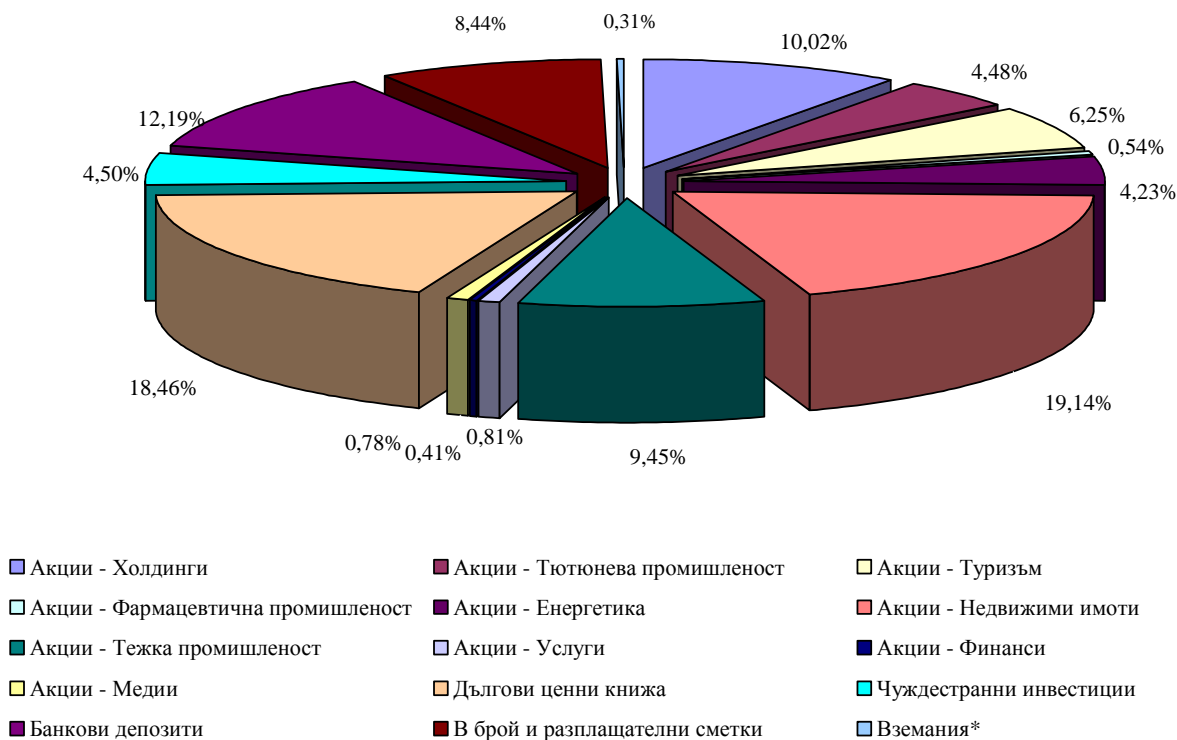


Асет Мениджмънт

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 30/09/2011		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	249 360	10,02%
Акции - Тютюнева промишленост	111 413	4,48%
Акции - Туризм	155 644	6,25%
Акции - Фармацевтична промишленост	13 377	0,54%
Акции - Енергетика	105 221	4,23%
Акции - Недвижими имоти	476 477	19,14%
Акции - Тежка промишленост	235 269	9,45%
Акции - Услуги	20 115	0,81%
Акции - Финанси	10 133	0,41%
Акции - Медии	19 518	0,78%
Дългови ценни книжа	459 389	18,46%
Чуждестранни инвестиции	111 969	4,50%
Банкови депозити	303 337	12,19%
В брой и разплащателни сметки	210 157	8,44%
Вземания*	7 674	0,31%
Обща сума	2 489 054	100,00%

* Вземания във връзка с предварително платена такса към БФБ и КФН, както и вземания от дивиденди и от продажба на права

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 30/09/2011





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	57 123,450	1,0000	\$57 123,45

Обща рискова позиция	\$57 123,45
----------------------	-------------

Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 39 000,00	1,386770	\$54 084,03	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$54 084,03		

Мирослав Маринов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД