

**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 31.08.2010г. 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 31.08.2010г. възлиза на 66,61%.

Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 31.08.2010г. възлизат на 20,49% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 10,15% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.08.2010г. са 1,87% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с дивиденди, лихвено плащане, както и предварително платена такса на БФБ и ЦД възлизат на 0,88% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.08.2010г. е минус 3,68% на годишна база\*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 14,21%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 31.08.2010г. е минус 2,19%, а доходността от началото на годината е минус 3,58%.

**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.

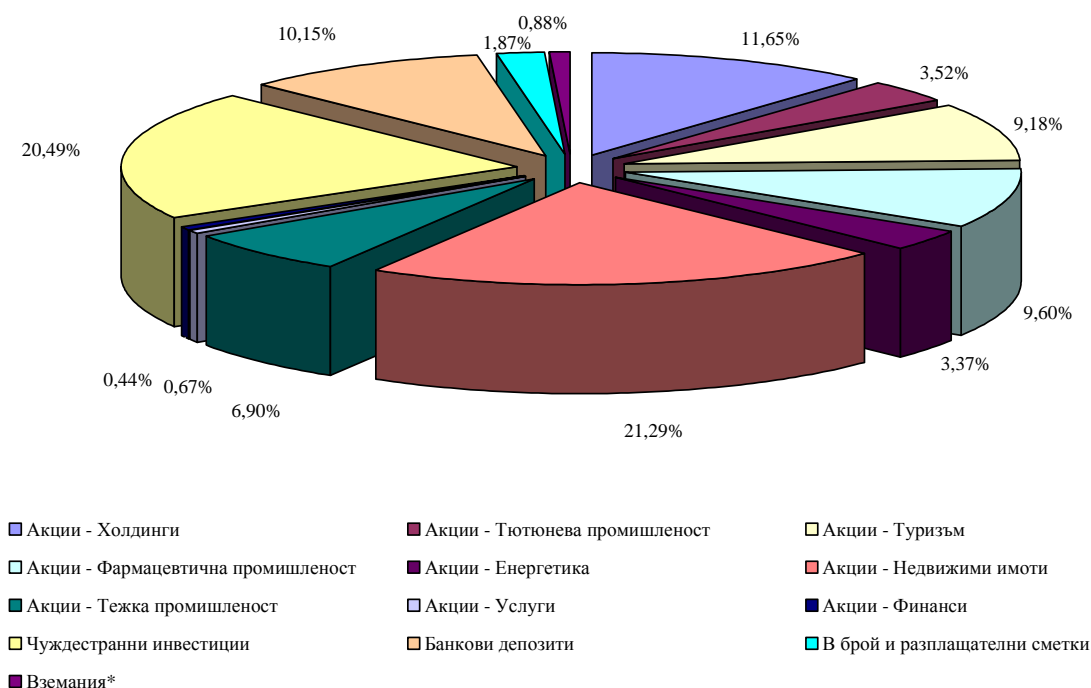
<b>Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31/08/2010</b>		
<b>Актив</b>	<b>Стойност в лева</b>	<b>Процент от активите</b>
Акции - Холдинги	322 837	11,65%
Акции - Тютюнева промишленост	97 649	3,52%
Акции - Туризъм	254 344	9,18%
Акции - Фармацевтична промишленост	266 051	9,60%
Акции - Енергетика	93 434	3,37%
Акции - Недвижими имоти	590 001	21,29%
Акции - Тежка промишленост	191 153	6,90%
Акции - Услуги	18 706	0,67%
Акции - Финанси	12 101	0,44%

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

Чуждестранни инвестиции	567 837	20,49%
Банкови депозити	281 373	10,15%
В брой и разплащателни сметки	51 782	1,87%
Вземания*	24 454	0,88%
Обща сума	2 771 723	100,00%

\* Вземания във връзка с дивиденди, лихвено плащане, както и предварително платена такса на БФБ и ЦД

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/08/2010**



## 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.

Рисков актив				
ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
Валутно деноминиран актив	USD	2 790,000	17,5221	\$48 886,66
Валутно деноминиран актив	USD	2 350,000	33,3700	\$78 419,50
Валутно деноминиран актив	USD	850,000	66,9548	\$56 911,58
Валутно деноминиран актив	USD	1 450,000	39,7894	\$57 694,63
<b>Обща рискова позиция</b>				<b>\$241 912,37</b>

<b>Дериватен инструмент</b>						
<b>Вид</b>	<b>Валута</b>	<b>Брой</b>	<b>Цена</b>	<b>Обща Стойност</b>	<b>Пазар</b>	<b>Държава</b>
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 208 000,00	1,307490	\$271 957,92	OTC	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>				\$271 957,92		

Стоян Тошев  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД