



Асет Мениджмънт

ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО ЧЛ. 48 и ЧЛ. 73Г ОТ НАРЕДБА № 25 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА ИНВЕСТИЦИОННИТЕ ДРУЖЕСТВА И ДОГОВОРНИ ФОНДОВЕ ЗА ДОГОВОРЕН ФОНД „ТИ БИ АЙ ДИНАМИК”

I. Данни по чл. 73г, ал. 1, т. 6 от Наредба № 25

1) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б „г”: Промени в структурата на портфейла през отчетния период

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 30.06.2011г. 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 30.06.2011г. възлиза на 59.77%.

Банковите депозити съставляват 10,51% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.06.2011г. са 27.07% от стойността на портфейла.

Взманията във връзка с предварително платена такса към БФБ, дивиденди и увеличение капитала на публично дружество възлизат на 2.65% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.06.2011г. е минус 1,88% на годишна база*. За същия период доходността на годишна база на индекса SOFIX е минус 11,37%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 30.06.2011г. е 12,71%.

2) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „а” и „д”: Промени в състоянието на активите в рамките на отчетния период

Долната таблица представя приходите на Фонда към 30.06.2011г. Приходите са в размер на 1 992 983 лв, включващи приходи от операции с финансови активи, приходи от лихви и положителни курсови разлики.

Приходи	Стойност в лева		
	31/12/2010	31/03/2011	30/06/2011
Приходи от лихви	23 955	5 186	10 313
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	4 042 171	974 501	1 685 019
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	561 913	138 619	286 909
Други финансови приходи	35 501	0	10 742
Общо приходи	4 663 541	1 118 306	1 992 983

Разходите на Фонда за отчетния период са представени в таблицата по-долу:

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



Асет Мениджмънт

Разходи	Стойност в лева		
	31.12.2010	31.3.2011	30.6.2011
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	4 059 316	794 743	1 563 980
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	555 792	137 143	284 489
Други разходи	5 222	1 319	2 708
Разходи за външни услуги	57 639	14 265	28 682
Общо разходи	4 677 969	947 470	1 879 859

Общият размер на разходите на фонда към 30.06.2011г. е 1 879 859 лева, които включват 1 563 980 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти, 284 489 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество
- към 30.06.2011г. – 25 726 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0,8927%
- б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество
- към 30.06.2011г. – 1 307 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.0454%
- в) Възнаграждение на банката депозитар
- към 30.06.2011г. – 1 200 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.0416%
- г) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие
- към 30.06.2011г. – 1 200 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.0416%
- д) Други разходи
- към 30.06.2011г. – 1 957 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.0679%
- Други разходи по финансови операции: 1 401 лв.
- Външни услуги (КФН, БФБ, ЦД и други услуги): 556 лв.
- е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 31 390 лв. към месец септември. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 1,0893 %.

За периода са записани 110,7631 дяла и са обратно изкупени 6 930,7522 дяла. НСА на фонда към 31.03.2011г. е 2 940 506,51 лв., а към 30.06.2011г. е 2 821 145,55 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 314 437,3924.



Асет Мениджмънт

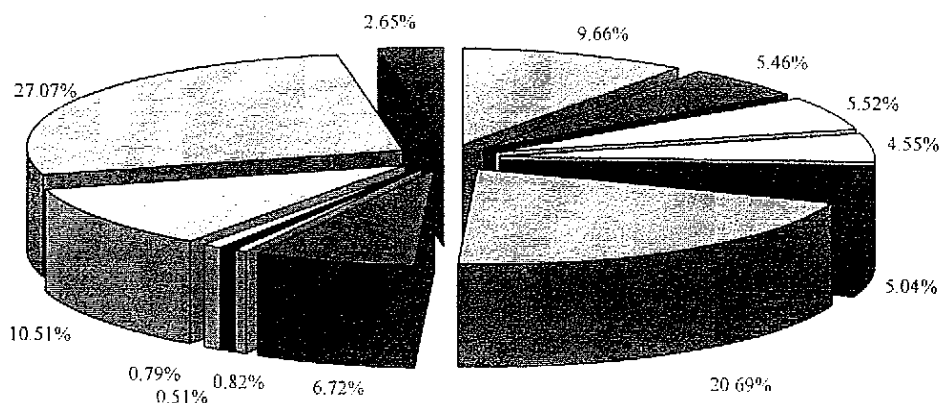
3) Дани по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „в“: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

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 30/06/2011		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	274 127	9.66%
Акции - Тютюнева промишленост	154 880	5.46%
Акции - Туризъм	156 742	5.52%
Акции - Фармацевтична промишленост	129 205	4.55%
Акции - Енергетика	142 918	5.04%
Акции - Недвижими имоти	586 953	20.69%
Акции - Тежка промишленост	190 557	6.72%
Акции - Услуги	23 183	0.82%
Акции - Финанси	14 514	0.51%
Акции - Медии	22 554	0.79%
Банкови депозити	298 119	10.51%
В брой и разплащателни сметки	768 043	27.07%
Вземания*	75 257	2.65%
Обща сума	2 837 051	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 30/06/2011



- Акции - Холдинги
- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Тежка промишленост
- Акции - Медии
- Вземания*
- Акции - Тютюнева промишленост
- Акции - Енергетика
- Акции - Услуги
- Банкови депозити
- Акции - Туризъм
- Акции - Недвижими имоти
- Акции - Финанси
- В брой и разплащателни сметки

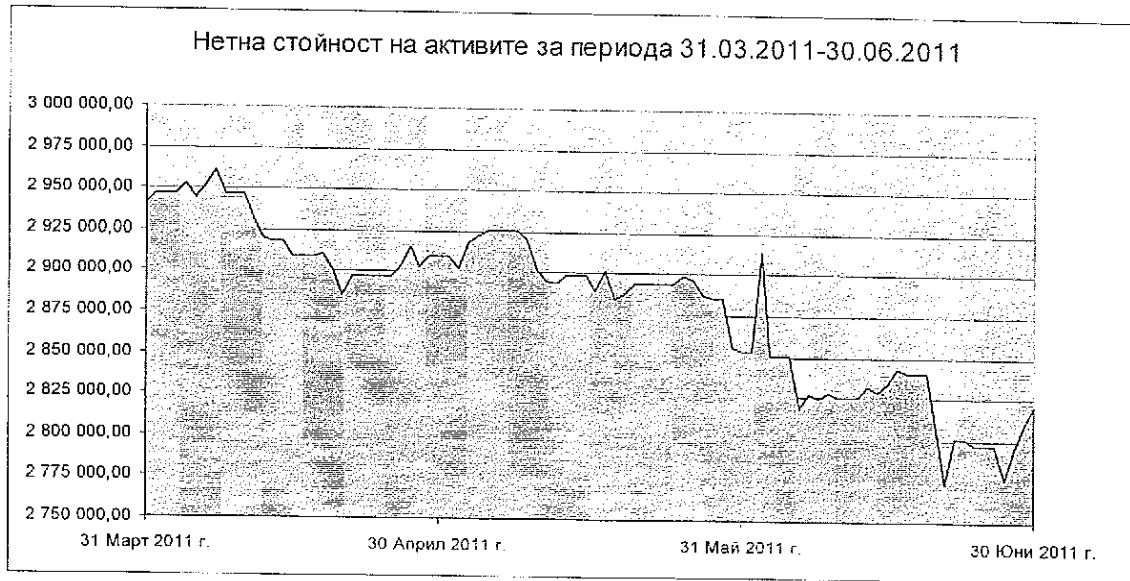


Асет Мениджмънт

4) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „б“: Нетна стойност на активите на един дял

На 31.03.2011г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 9,1531 лв. Към 30.06.2011г. нетната стойност на активите на един дял е 8,9720 лв.

Изменението на нетната стойност на активите на Фонда е представено на следващата графика.





Асет Мениджмънт

II. Данни по чл. 48, ал. 3, т. 2 от 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	292 132,010	1,0000	\$292 132,01
Обща рискова позиция				\$292 132,01

Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 199 000,00	1,462400	\$291 017,60	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$291 017,60		

Мирослав Маринов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД