

**ИНФОРМАЦИЯ  
СЪГЛАСНО ЧЛ. 72 ОТ НАРЕДБА № 44 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ  
ДЕЙНОСТТА НА КИС, ИД ОТ ЗАТВОРЕН ТИП И УД****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 продажбите на акции от български публични дружества, търгувани на БФБ – София АД. През периода са закупени и продадени и чуждестранни инвестиции.

Към 31.07.2012г. 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 31.07.2012г. възлиза на 39.56%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 6.58% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.07.2012г. корпоративните облигации представляват 6.77% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик, а ипотечните облигации 4.35% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 12.79% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.07.2012г. са 23.10% от стойността на портфейла.

Вземанията от начислени дивиденди, лихвено и главнично плащане по емисия корпоративни облигации, както и от предварително платени такси към БФБ възлизат на 6.85% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.07.2012г. е минус 3.47% на годишна база\*. Доходността от началото на годината е минус 2.13%, а доходността за последните 12 месеца към 31.07.2012г. е минус 11.66%.

**I. Данни по чл. 72, ал. 2 от Наредба № 44**

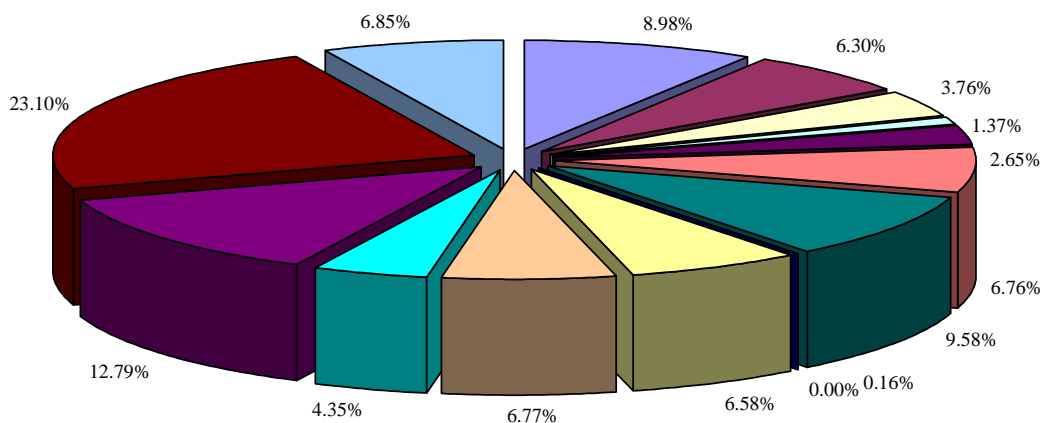
**1) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти**

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31.07.2012г. е представена в следната таблица и графика.

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

<b>Структура на портфейла на ДФ "Ти Би Ай Динамик" към 31/07/2012</b>		
<b>Актив</b>	<b>Стойност в лева</b>	<b>Процент от активите</b>
Акции - Холдинги	175 566	8.98%
Акции - Туризм	123 188	6.30%
Акции - Фармацевтична промишленост	73 554	3.76%
Акции - Енергетика	26 730	1.37%
Акции - Финанси	51 858	2.65%
Акции - Недвижими имоти	132 060	6.76%
Акции - Тежка промишленост	187 366	9.58%
Акции - Лека промишленост	3 147	0.16%
Акции - Медии	63	0.00%
Чуждестранни инвестиции	128 587	6.58%
Корпоративни облигации	132 444	6.77%
Ипотечни облигации	85 018	4.35%
Банкови депозити	250 160	12.79%
В брой и разплащателни сметки	451 707	23.10%
Вземания*	133 813	6.85%
<b>Общо активи</b>	<b>1 955 261</b>	<b>100.00%</b>
* Вземания във връзка с начислени дивиденди, лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, предварително платени такси към БФБ и КФН, вземания от хеджиране и др.		

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/07/2012**



- |                              |                                 |                                      |
|------------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| ■ Акции - Холдинги           | ■ Акции - Туризм                | □ Акции - Фармацевтична промишленост |
| □ Акции - Енергетика         | ■ Акции - Финанси               | ■ Акции - Недвижими имоти            |
| ■ Акции - Тежка промишленост | □ Акции - Лека промишленост     | ■ Акции - Медии                      |
| ■ Чуждестранни инвестиции    | ■ Корпоративни облигации        | ■ Ипотечни облигации                 |
| ■ Банкови депозити           | ■ В брой и разплащателни сметки | ■ Вземания*                          |

**2) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 2: Видове деривативни инструменти, основни рискове, свързани с базовите активи на деривативните инструменти, количествени ограничения и избрани методи за оценка на риска, свързан със сделките с деривативни инструменти**

Към настоящия момент, сключените от управляващото дружество сделки с деривативни инструменти са единствено с цел управление на риска – хеджиране.

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.

<b>Рисков актив</b>				
<b>ISIN</b>	<b>Валута</b>	<b>Брой</b>	<b>Цена</b>	<b>Обща Стойност</b>
Валутно деноминиран актив	USD	210 317.360	1.0000	\$210 317.36
Валутно деноминиран актив	USD	1 629.000	35.9200	\$58 513.68
<b>Обща рискова позиция</b>				<b>\$268 831.04</b>

<b>Деривативен 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	€ 229 000.00	1.22963	\$281 585.27	OTC	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>				<b>\$281 585.27</b>		

Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД