

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. Закупени са чуждестранни инвестиции и са продадени ипотечни облигации.

Към 30.04.2013г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик са разпределени в 7 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 30.04.2013г. възлиза на 51.98%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 12.60% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 30.04.2013г. корпоративните облигации представляват 7.15% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик, а ипотечните облигации 3.60% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 15.84% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.04.2013г. са 3.40% от стойността на портфейла.

Вземанията от лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации и платени такси към БФБ и КФН възлизат на 5.43% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.04.2013 г. е минус 2.37% на годишна база*. Доходността от началото на годината е 6.78% , а доходността за последните 12 месеца към 30.04.2013г. е 6.92%.

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

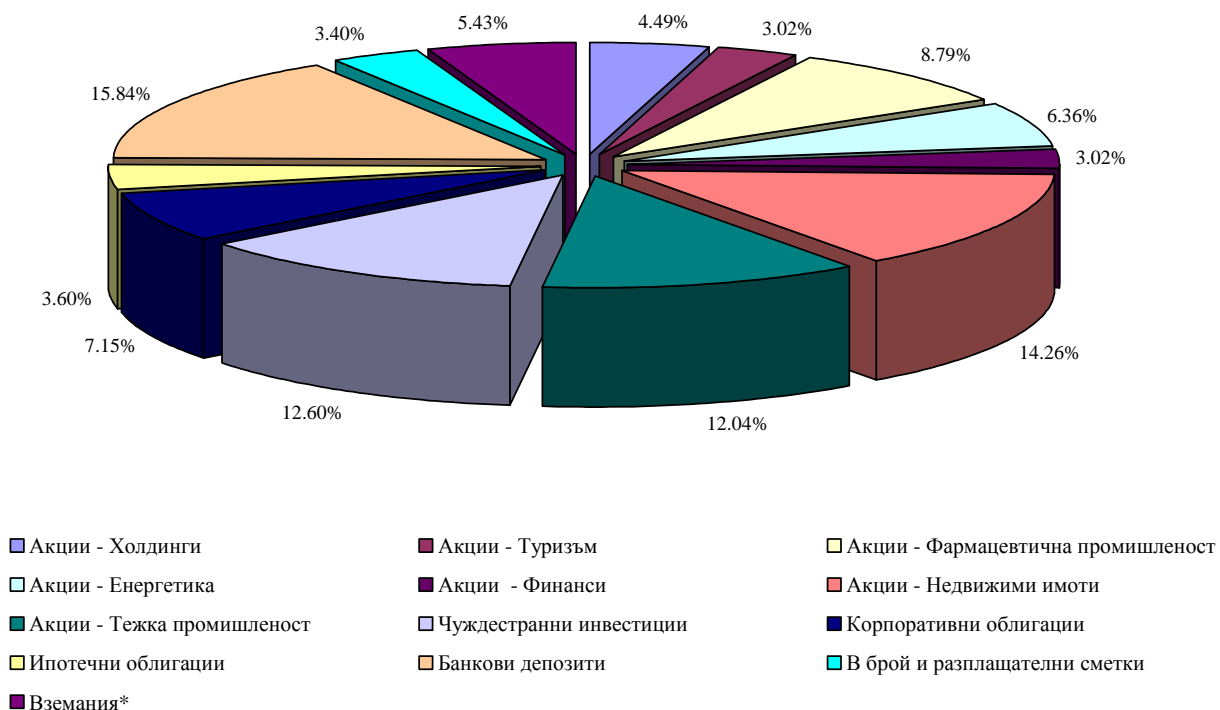
1) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 30.04.2013г. е представена в следната таблица и графика.

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

Структура на портфейла на ДФ "Ти Би Ай Динамик" към 30/04/2013		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	87 927	4.49%
Акции - Туризм	59 265	3.02%
Акции - Фармацевтична промишленост	172 333	8.79%
Акции - Енергетика	124 580	6.36%
Акции - Финанси	59 132	3.02%
Акции - Недвижими имоти	279 589	14.26%
Акции - Тежка промишленост	235 989	12.04%
Чуждестранни инвестиции	246 999	12.60%
Корпоративни облигации	140 243	7.15%
Ипотечни облигации	70 524	3.60%
Банкови депозити	310 583	15.84%
В брой и разплащателни сметки	66 710	3.40%
Вземания*	106 499	5.43%
Общо активи	1 960 373	100.00%

* Вземания във връзка лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, платени такси към БФБ и КФН.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 30/04/2013


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.

Рисков актив				
ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
Валутно деноминиран актив	USD	1 582.020	1.0000	\$1 582.02
Валутно деноминиран актив	USD	487.000	122.1300	\$59 477.31
Валутно деноминиран актив	USD	329.000	159.6800	\$52 534.72
Валутно деноминиран актив	USD	705.000	75.2800	\$53 072.40

Обща рискова позиция	\$166 666.45
-----------------------------	--------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 123 000.00	1.308640	\$160 962.72	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$160 962.72		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

