



Асет Мениджмънт

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 и са продадени корпоративни облигации, също така през периода са закупени и ипотечни облигации.

Към 31.12.2011г. 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 31.12.2011г. възлиза на 55.52%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 9.42% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.12.2011г. корпоративните облигации представляват 16.24% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик, а ипотечните облигации 4.26% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 13.69% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.12.2011г. са 0.77% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисия корпоративни облигации възлизат на 0.10% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.12.2011г. е -3.46% на годишна база*. Доходността от началото на годината е -6.91%, а доходността за последните 12 месеца към 31.12.2011г. е -6.91%.

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

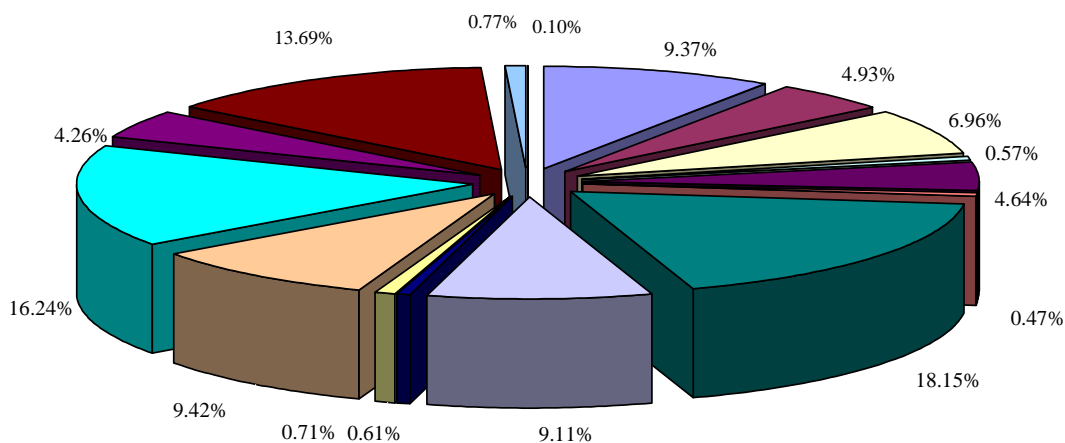
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31.12.2011г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 31/12/2011		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	211 204	9.37%
Акции - Тютюнева промишленост	111 216	4.93%
Акции - Туризм	156 905	6.96%
Акции - Фармацевтична промишленост	12 901	0.57%
Акции - Енергетика	104 723	4.64%
Акции - Финанси	10 662	0.47%
Акции - Недвижими имоти	409 218	18.15%
Акции - Тежка промишленост	205 319	9.11%
Акции - Лека промишленост	13 805	0.61%
Акции - Медии	16 053	0.71%
Чуждестранни инвестиции	212 375	9.42%
Корпоративни облигации	366 146	16.24%
Ипотечни облигации	96 021	4.26%
Банкови депозити	308 645	13.69%
В брой и разплащателни сметки	17 331	0.77%
Вземания*	2 085	0.10%
Общо активи	2 254 610	100.00%

* 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 31/12/2011



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

2) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 2 от Наредба № 44: 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

Съгласно действащите Правила за Управление на риска на Фонда, рисковата експозиция на колективната инвестиционна схема към насрещната страна по сделка с деривативни финансови инструменти, търгувани на извънборсови пазари, не може да надхвърля 10 на сто от активите, когато насрещната страна е банка, а в останалите случаи - 5 на сто от активите.

Управляващото дружество сключва сделки с деривативни инструменти 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	5 243.710	1.0000	\$5 243.71
Валутно деноминиран актив	USD	1 665.000	32.6608	\$54 380.23
Обща рискова позиция				\$59 623.94

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 39 000.00	1.342800	\$52 369.20	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$52 369.20		

Мирослав Маринов
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД