

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 на акции от български публични дружества, търгувани на БФБ – София АД. Продадени са чуждестранни инвестиции и са падежирали ипотечни облигации.

Към 30.06.2013г. 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 30.06.2013г. възлиза на 52.16%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 7.43% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 30.06.2013г. корпоративните облигации представляват 6.50% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Банковите депозити съставляват 15.41% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.06.2013г. са 12.63% от стойността на портфейла.

Вземанията от лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, начислени дивиденди и платени такси към БФБ и КФН възлизат на 5.87% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 28.06.2013 г. е минус 1.81% на годишна база*. Доходността от началото на годината е 11.29% , а доходността за последните 12 месеца към 28.06.2013г. е 14.20%.

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

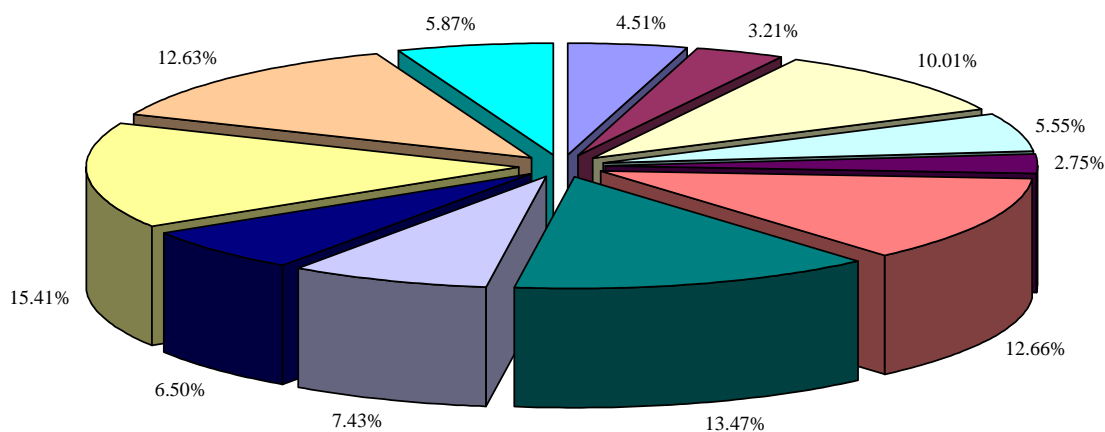
1) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 30.06.2013г. 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 30.06.2013 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
<i>Акции - Холдинги</i>	91 928	4.51%
<i>Акции - Туризм</i>	65 473	3.21%
<i>Акции - Фармацевтична промишленост</i>	204 084	10.01%
<i>Акции - Енергетика</i>	113 040	5.55%
<i>Акции - Финанси</i>	56 010	2.75%
<i>Акции - Недвижими имоти</i>	258 132	12.66%
<i>Акции - Тежка промишленост</i>	274 624	13.47%
<i>Чуждестранни инвестиции</i>	151 361	7.43%
<i>Корпоративни облигации</i>	132 484	6.50%
<i>Банкови депозити</i>	314 077	15.41%
<i>В брой и разплащателни сметки</i>	257 535	12.63%
<i>Вземания*</i>	119 648	5.87%
<i>Общо активи</i>	2 038 396	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 30/06/2013


- | | | |
|------------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| ■ Акции - Холдинги | ■ Акции - Туризм | □ Акции - Фармацевтична промишленост |
| □ Акции - Енергетика | ■ Акции - Финанси | ■ Акции - Недвижими имоти |
| ■ Акции - Тежка промишленост | □ Чуждестранни инвестиции | ■ Корпоративни 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.

Рисков актив				
ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
Валутно деноминиран актив	USD	59 024.900	1.0000	\$59 024.90
Валутно деноминиран актив	USD	329.000	160.420	\$52 778.18
Валутно деноминиран актив	USD	705.000	68.720	\$48 447.60
Обща рискова позиция				\$160 250.68

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 123 000.00	1.336400	\$164 377.20	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$164 377.20		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД