

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 чуждестранни инвестиции.

Към 30.09.2012г. 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 30.09.2012г. възлиза на 45.24%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 4.90% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 30.09.2012г. корпоративните облигации представляват 6.70% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик, а ипотечните облигации 4.35% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 13.03% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.09.2012г. са 19.37% от стойността на портфейла.

Вземанията от начислени дивиденди, лихвено и главнично плащане по емисия корпоративни облигации, както и от предварително платени такси към БФБ и КФН възлизат на 6.41% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.09.2012г. е минус 3.40% на годишна база*. Доходността от началото на годината е минус 2.24%, а доходността за последните 12 месеца към 29.09.2012г. е минус 7.02%.

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

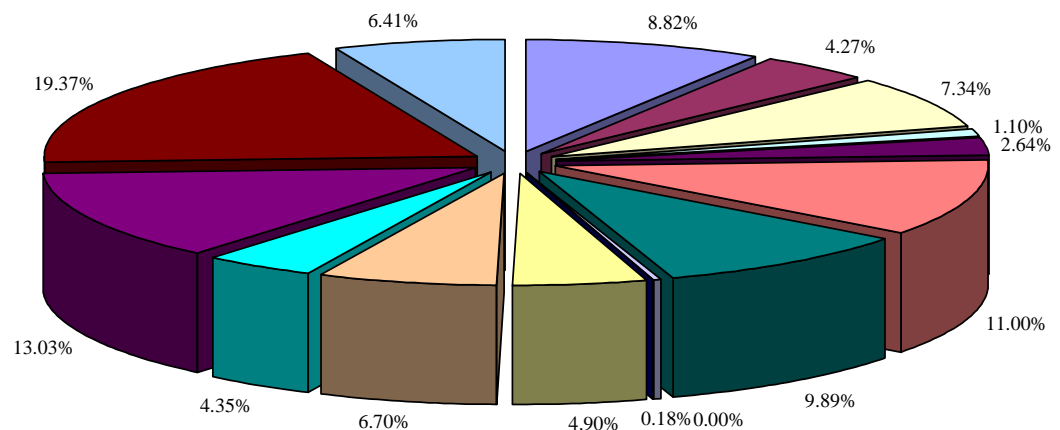
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 30.09.2012г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 30/09/2012

Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	171 396	8.82%
Акции - Туризм	82 892	4.27%
Акции - Фармацевтична промишленост	142 610	7.34%
Акции - Енергетика	21 440	1.10%
Акции - Финанси	51 224	2.64%
Акции - Недвижими имоти	213 543	11.00%
Акции - Тежка промишленост	192 127	9.89%
Акции - Лека промишленост	3 549	0.18%
Акции - Медии	63	0.00%
Чуждестранни инвестиции	95 167	4.90%
Корпоративни облигации	130 241	6.70%
Ипотечни облигации	84 409	4.35%
Банкови депозити	253 022	13.03%
В брой и разплащателни сметки	376 365	19.37%
Вземания*	124 521	6.41%
Общо активи	1 942 569	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 30/09/2012


- | | | |
|----------------------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 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.

Рисков актив				
ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
Валутно деноминиран актив	USD	198 251.340	1.0000	\$198 251.34
Валутно деноминиран актив	USD	437.000	143.9700	\$62 914.89
Обща рискова позиция				\$261 166.23

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 198 000.00	1.30984	\$259 348.32	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$259 348.32		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД