

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.

Към 31.05.2013г. 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 31.05.2013г. възлиза на 50.97%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 12.04% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.05.2013г. корпоративните облигации представляват 6.87% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик, а ипотечните облигации 3.53% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 15.52% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.05.2013г. са 4.16% от стойността на портфейла.

Вземанията от лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, от хеджиране, начислени дивиденди и платени такси към БФБ и КФН възлизат на 6.91% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.05.2013 г. е минус 2.00% на годишна база*. Доходността от началото на годината е 9.75% , а доходността за последните 12 месеца към 31.05.2013г. е 13.73%.

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

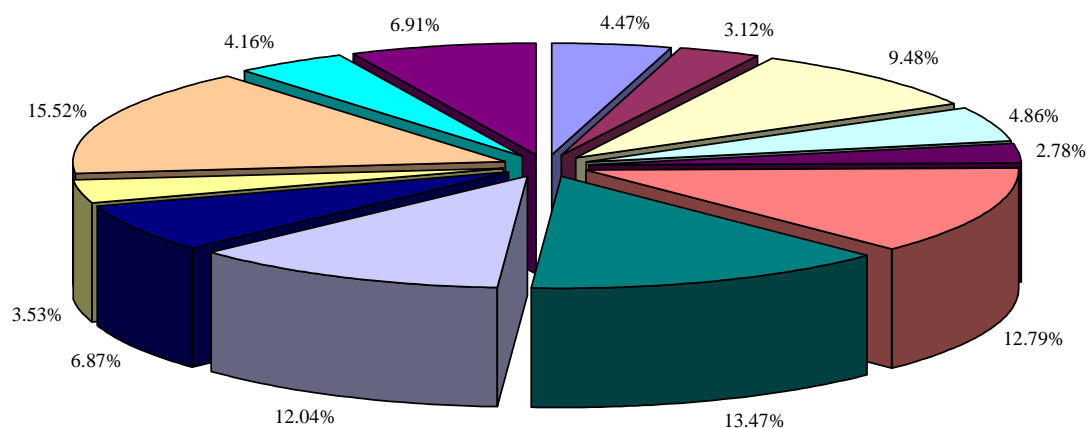
1) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31.05.2013г. 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 31.05.2013 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
<i>Акции - Холдинги</i>	90 047	4.47%
<i>Акции - Туризм</i>	62 749	3.12%
<i>Акции - Фармацевтична промишленост</i>	190 827	9.48%
<i>Акции - Енергетика</i>	97 812	4.86%
<i>Акции - Финанси</i>	55 955	2.78%
<i>Акции - Недвижими имоти</i>	257 328	12.79%
<i>Акции - Тежка промишленост</i>	271 159	13.47%
<i>Чуждестранни инвестиции</i>	242 210	12.04%
<i>Корпоративни облигации</i>	138 370	6.87%
<i>Ипотечни облигации</i>	70 990	3.53%
<i>Банкови депозити</i>	312 390	15.52%
<i>В брой и разплащателни сметки</i>	83 657	4.16%
<i>Вземания*</i>	138 981	6.91%
<i>Общо активи</i>	2 012 475	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 31/05/2013


- | | | |
|------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|
| ■ Акции - Холдинги | ■ Акции - Туризм | ■ Акции - Фармацевтична промишленост |
| ■ Акции - Енергетика | ■ Акции - Финанси | ■ Акции - Недвижими имоти |
| ■ Акции - Тежка промишленост | ■ 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	1 701.550	1.0000	\$1 701.55
Валутно деноминиран актив	USD	487.000	117.850	\$57 392.95
Валутно деноминиран актив	USD	329.000	163.445	\$53 773.41
Валутно деноминиран актив	USD	705.000	70.780	\$49 899.90
Обща рискова позиция				\$162 767.81

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 123 000.00	1.289930	\$158 661.39	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$158 661.39		

Красимир Петков
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД