

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 корпоративни облигации.

Към 31.10.2012г. 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 31.10.2012г. възлиза на 54.41%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 4.85% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.10.2012г. корпоративните облигации представляват 7.45% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик, а ипотечните облигации 4.52% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 13.27% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.10.2012г. са 9.20% 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 6.30% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.10.2012г. е минус 3.51% на годишна база*. Доходността от началото на годината е минус 3.27%, а доходността за последните 12 месеца към 31.10.2012г. е минус 6.13%.

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

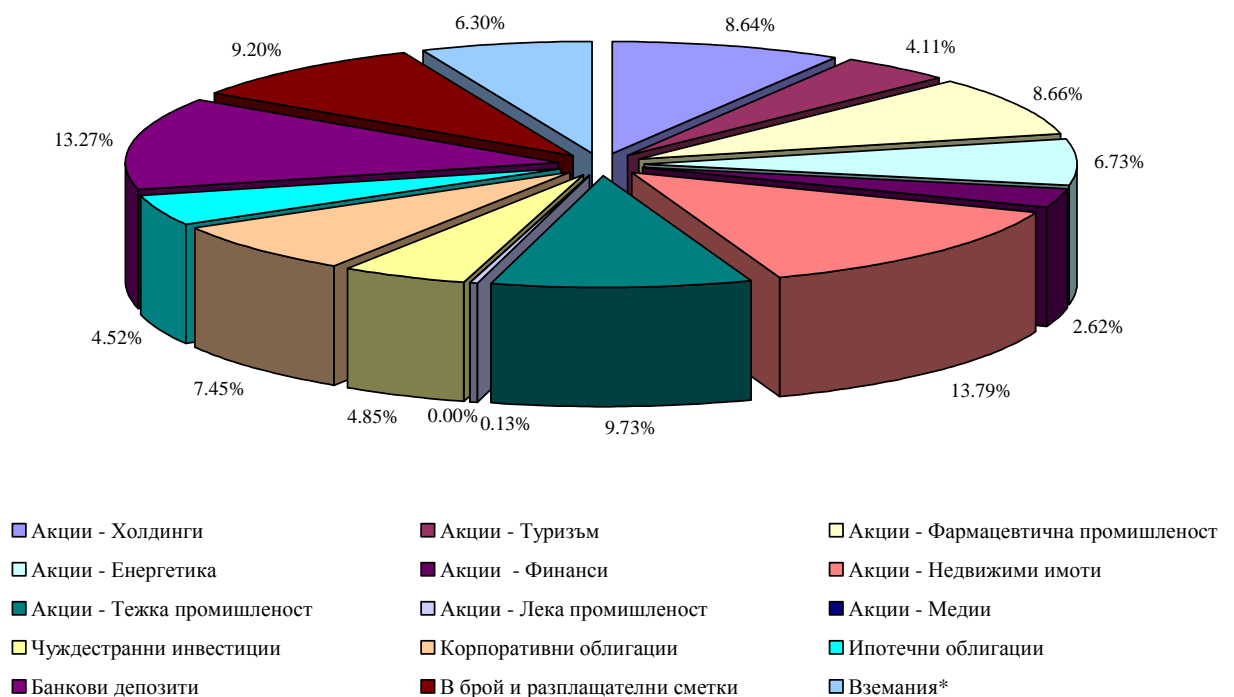
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31.10.2012г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 31/10/2012

Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	165 725	8.64%
Акции - Туризм	78 810	4.11%
Акции - Фармацевтична промишленост	166 072	8.66%
Акции - Енергетика	129 146	6.73%
Акции - Финанси	50 337	2.62%
Акции - Недвижими имоти	264 418	13.79%
Акции - Тежка промишленост	186 707	9.73%
Акции - Лека промишленост	2 498	0.13%
Акции - Медии	63	0.00%
Чуждестранни инвестиции	92 982	4.85%
Корпоративни облигации	142 832	7.45%
Ипотечни облигации	86 681	4.52%
Банкови депозити	254 538	13.27%
В брой и разплащателни сметки	176 427	9.20%
Вземания*	120 919	6.30%
Общо активи	1 918 155	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 31/10/2012


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	103 485.910	1.0000	\$103 485.91
Валутно деноминиран актив	USD	437.000	141.3500	\$61 769.95
Обща рискова позиция				\$165 255.86

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 198 000.00	1.31197	\$259 770.06	OTC	България
Форуърд продава EUR/USD	EUR/USD	- € 70 000.000	1.29257	-\$90 479.90	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$169 290.16		

Красимир Петков
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД