

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 продадени корпоративни облигации, закупени са и са продадени чуждестранни инвестиции.

Към 30.04.2012г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик са разпределени в 8 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 30.04.2012г. възлиза на 48.42%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 20.26% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 30.04.2012г. корпоративните облигации представляват 6.85% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик, а ипотечните облигации 4.35% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 12.35% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.04.2012г. са 7.61% от стойността на портфейла.

Вземанията от начислени дивиденди, хеджиране, предварително платени такси към КФН и БФБ възлизат на 0.16% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 27.04.2012г. е минус 3.71% на годишна база*. Доходността от началото на годината е минус 2.83%, а доходността за последните 12 месеца към 27.04.2012г. е минус 14.57%.

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

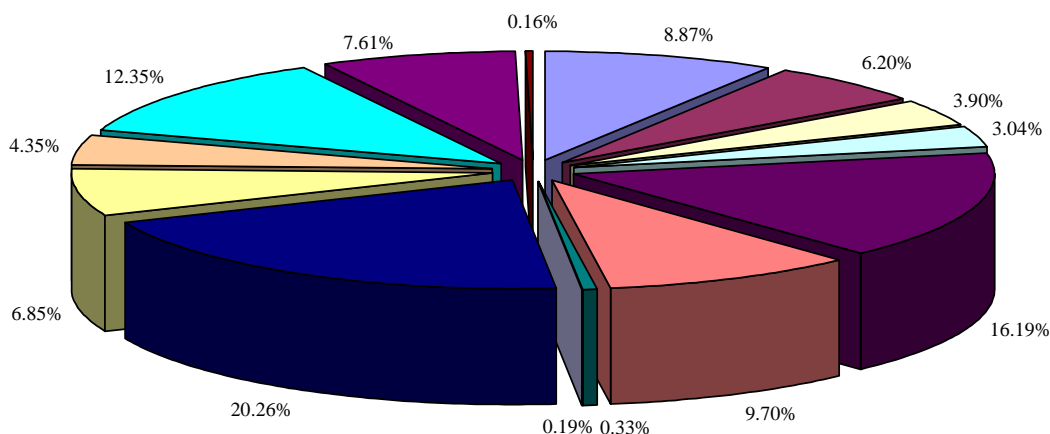
* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 30.04.2012г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ "Ти Би Ай Динамик" към 30/04/2012		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	176 375	8.87%
Акции - Туризм	123 258	6.20%
Акции - Фармацевтична промишленост	77 554	3.90%
Акции - Енергетика	60 389	3.04%
Акции - Недвижими имоти	322 014	16.19%
Акции - Тежка промишленост	192 975	9.70%
Акции - Лека промишленост	6 548	0.33%
Акции - Медии	3 856	0.19%
Чуждестранни инвестиции	402 933	20.26%
Корпоративни облигации	136 269	6.85%
Ипотечни облигации	86 601	4.35%
Банкови депозити	245 714	12.35%
В брой и разплащателни сметки	151 308	7.61%
Вземания*	3 212	0.16%
Общо активи	1 989 006	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 30/04/2012



- | | | |
|---------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|
| ■ Акции - Холдинги | ■ Акции - Туризм | ■ Акции - Фармацевтична промишленост |
| ■ Акции - Енергетика | ■ 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

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 по чл. 38, ал. 1, т. 6 от ЗДКИСДПКИ, 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	34 244.960	1.0000	\$34 244.96
Валутно деноминиран актив	USD	527.000	131.7893	\$69 452.96
Валутно деноминиран актив	USD	1 653.000	57.6800	\$95 345.04
Валутно деноминиран актив	USD	968.000	70.4900	\$68 234.32
Валутно деноминиран актив	USD	282.000	140.0941	\$39 506.54

Обща рискова позиция	\$306 783.82
-----------------------------	---------------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 164 000.00	1.3130	\$215 336.92	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 37 000.00	1.3187	\$48 791.90	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$264 128.82		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД