

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 и чуждестранни инвестиции.

Към 31.05.2012г. 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 31.05.2012г. възлиза на 42.73%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 13.51% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.05.2012г. корпоративните облигации представляват 6.98% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик, а ипотечните облигации 4.58% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 12.99% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.05.2012г. са 18.75% от стойността на портфейла.

Вземанията от начислени дивиденди, лихвено и главнично плащане по емисия корпоративни облигации както и от предварително платени такси към КФН и БФБ възлизат на 0.46% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.05.2012г. е минус 4.15% на годишна база*. Доходността от началото на годината е минус 6.12%, а доходността за последните 12 месеца към 31.05.2012г. е минус 16.35%.

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

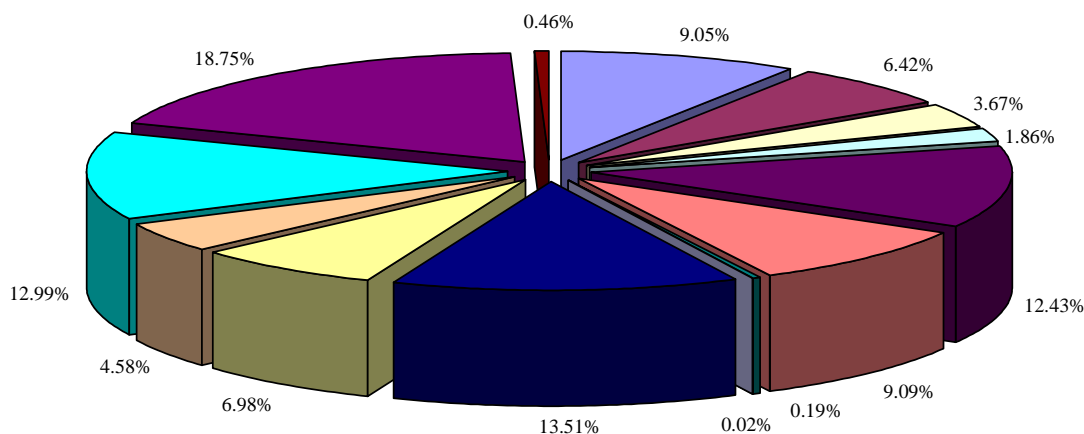
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31.05.2012г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 31/05/2012		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	172 218	9.05%
Акции - Туризм	122 237	6.42%
Акции - Фармацевтична промишленост	69 775	3.67%
Акции - Енергетика	35 344	1.86%
Акции - Недвижими имоти	236 744	12.43%
Акции - Тежка промишленост	172 967	9.09%
Акции - Лека промишленост	3 663	0.19%
Акции - Медии	386	0.02%
Чуждестранни инвестиции	257 301	13.51%
Корпоративни облигации	132 957	6.98%
Ипотечни облигации	87 225	4.58%
Банкови депозити	247 288	12.99%
В брой и разплащателни сметки	356 876	18.75%
Вземания*	8 744	0.46%
Общо активи	1 903 725	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 31/05/2012



- | | | |
|---------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|
| ■ 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	130 189.000	1.0000	\$130 189.00
Валутно деноминиран актив	USD	527.000	123.9866	\$65 340.94
Валутно деноминиран актив	USD	968.000	62.6700	\$60 664.56
Валутно деноминиран актив	USD	282.000	131.7845	\$37 163.23

Обща рискова позиция	\$293 357.73
-----------------------------	---------------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форурд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 229 000.00	1.2736	\$291 647.53	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$291 647.53		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД