

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. Закупени са и чуждестранни инвестиции.

Към 31.08.2013г. 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 31.08.2013г. възлиза на 44.23%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 12.08% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.08.2013г. корпоративните облигации представляват 6.42% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Банковите депозити съставляват 15.67% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.08.2013г. са 14.89% от стойността на портфейла.

Вземанията от лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, начислени дивиденди и платени такси към БФБ и КФН възлизат на 6.71% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.08.2013 г. е минус 1.71% на годишна база*. Доходността от началото на годината е 11.79% , а доходността за последните 12 месеца към 30.08.2013г. е 10.59%.

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

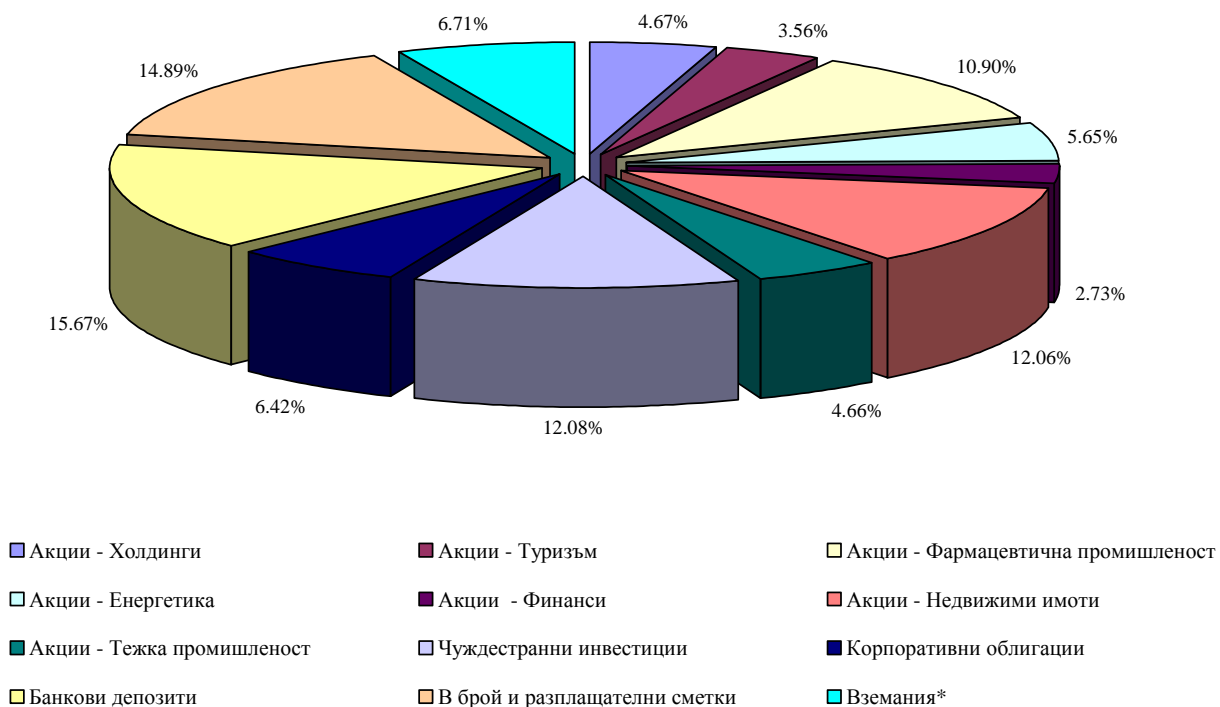
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31.08.2013г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 31.08.2013 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	94 682	4.67%
Акции - Туризъм	72 148	3.56%
Акции - Фармацевтична промишленост	221 254	10.90%
Акции - Енергетика	114 536	5.65%
Акции - Финанси	55 414	2.73%
Акции - Недвижими имоти	244 692	12.06%
Акции - Тежка промишленост	94 585	4.66%
Чуждестранни инвестиции	244 981	12.08%
Корпоративни облигации	130 238	6.42%
Банкови депозити	317 811	15.67%
В брой и разплащателни сметки	301 998	14.89%
Вземания*	136 213	6.71%
Общо активи	2 028 552	100.00%

* Вземания във връзка с начислени дивиденди, лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, предварително платени такси към БФБ и КФН.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/08/2013



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	59 210.270	1.0000	\$59 210.27
Валутно деноминиран актив	USD	329.000	163.650	\$53 840.85
Валутно деноминиран актив	USD	705.000	64.500	\$45 472.50
Обща рискова позиция				\$158 523.62

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 123 000.00	1.327517	\$163 284.59	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$163 284.59		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД