

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 са продадени корпоративни облигации.

Към 31.03.2012г. 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 31.03.2012г. възлиза на 46.45%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 17.40% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.03.2012г. корпоративните облигации представляват 14.05% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик, а ипотечните облигации 4.32% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 12.24% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.03.2012г. са 5.33% от стойността на портфейла.

Вземанията от начислени дивиденди, хеджиране, предварително платени такси към КФН и БФБ, както и от лихвено плащане по предоставен депозит възлизат на 0.21% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.03.2012г. е минус 3.76% на годишна база*. Доходността от началото на годината е минус 2.88%, а доходността за последните 12 месеца към 30.03.2012г. е минус 14.66%.

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

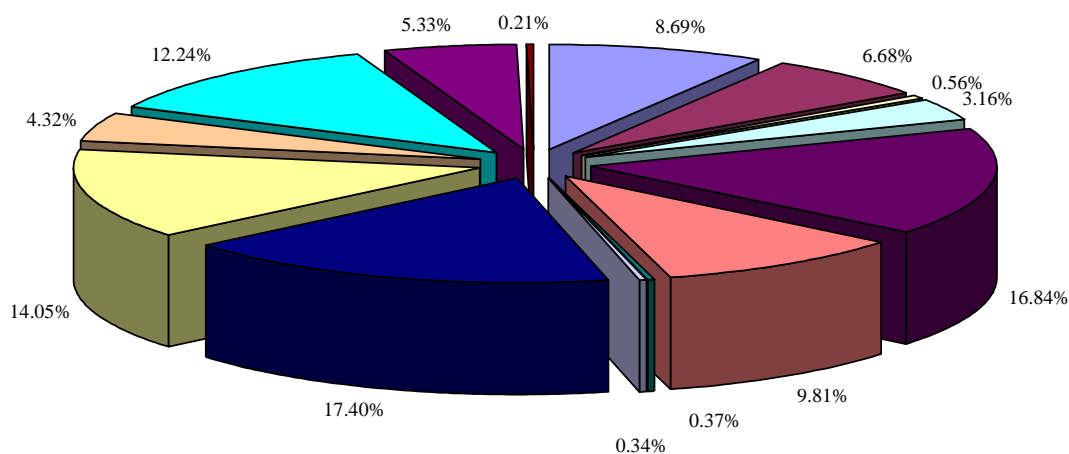
1) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти

* 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 31.03.2012г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ "Ти Би Ай Динамик" към 31/03/2012		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	173 334	8.69%
Акции - Туризм	133 236	6.68%
Акции - Фармацевтична промишленост	11 220	0.56%
Акции - Енергетика	63 037	3.16%
Акции - Недвижими имоти	335 770	16.84%
Акции - Тежка промишленост	195 637	9.81%
Акции - Лека промишленост	7 376	0.37%
Акции - Медии	6 811	0.34%
Чуждестранни инвестиции	346 697	17.40%
Корпоративни облигации	280 055	14.05%
Ипотечни облигации	86 086	4.32%
Банкови депозити	243 959	12.24%
В брой и разплащателни сметки	106 297	5.33%
Вземания*	4 042	0.21%
Общо активи	1 993 557	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 31/03/2012


- | | | |
|---------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|
| ■ 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	505.700	1.0000	\$505.70
Валутно деноминиран актив	USD	1 665.000	33.8568	\$56 371.57
Валутно деноминиран актив	USD	1 237.000	57.9600	\$71 696.52
Валутно деноминиран актив	USD	282.000	140.2666	\$39 555.18
Валутно деноминиран актив	USD	527.000	131.1769	\$69 130.23

Обща рискова позиция	\$237 259.20
-----------------------------	---------------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форурд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 164 000.00	1.3229	\$216 960.52	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$216 960.52		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД