

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 чуждестранни инвестиции.

Към 31.08.2012г. 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 31.08.2012г. възлиза на 40.09%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 11.19% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.08.2012г. корпоративните облигации представляват 6.59% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик, а ипотечните облигации 4.27% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 12.81% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.08.2012г. са 17.52% от стойността на портфейла.

Вземанията от начислени дивиденди, хеджиране, лихвено и главнично плащане по емисия корпоративни облигации, както и от предварително платени такси към БФБ възлизат на 7.53% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.08.2012г. е минус 3.32% на годишна база*. Доходността от началото на годината е минус 1.39%, а доходността за последните 12 месеца към 31.08.2012г. е минус 6.11%.

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

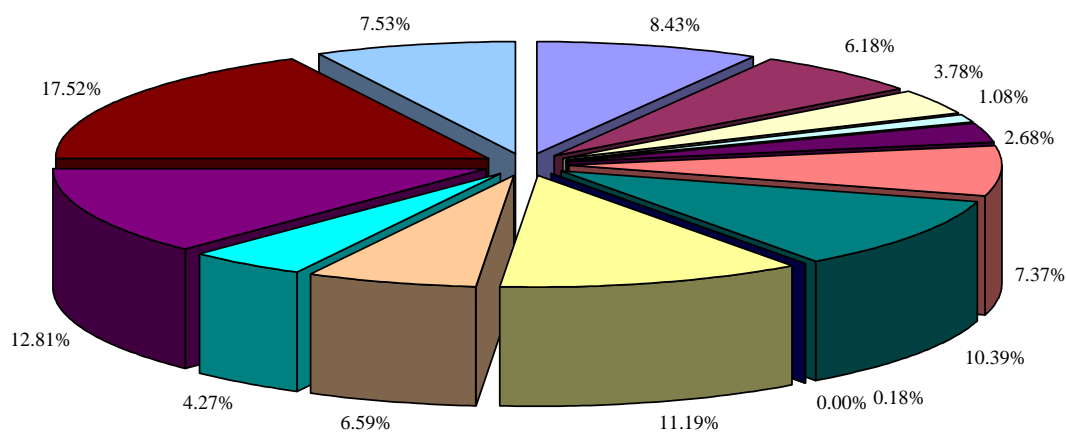
1) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31.08.2012г. 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 31/08/2012		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	165 541	8.43%
Акции - Туризм	121 383	6.18%
Акции - Фармацевтична промишленост	74 387	3.78%
Акции - Енергетика	21 262	1.08%
Акции - Финанси	52 640	2.68%
Акции - Недвижими имоти	144 738	7.37%
Акции - Тежка промишленост	204 162	10.39%
Акции - Лека промишленост	3 459	0.18%
Акции - Медии	65	0.00%
Чуждестранни инвестиции	219 937	11.19%
Корпоративни облигации	129 503	6.59%
Ипотечни облигации	83 875	4.27%
Банкови депозити	251 615	12.81%
В брой и разплащателни сметки	344 316	17.52%
Вземания*	147 997	7.53%
Общо активи	1 964 880	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 31/08/2012


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

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	147 493.500	1.0000	\$147 493.50
Валутно деноминиран актив	USD	503.000	127.7200	\$64 243.16
Валутно деноминиран актив	USD	1 629.000	35.0600	\$57 112.74
Обща рискова позиция				\$268 849.40

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 218 000.00	1.22645	\$267 366.10	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$267 366.10		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД