

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 корпоративни облигации.

Към 31.12.2012г. 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 31.12.2012г. възлиза на 53.86%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 9.60% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.12.2012г. корпоративните облигации представляват 7.63% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик, а ипотечните облигации 4.54% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 13.83% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.12.2012г. са 4.81% от стойността на портфейла.

Вземанията от хеджиране, лихвено и главнично плащане по емисия корпоративни облигации възлизат на 5.73% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.12.2012г. е минус 3.35% на годишна база*. Доходността от началото на годината и доходността за последните 12 месеца към 31.12.2012г. е минус 2.71%.

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

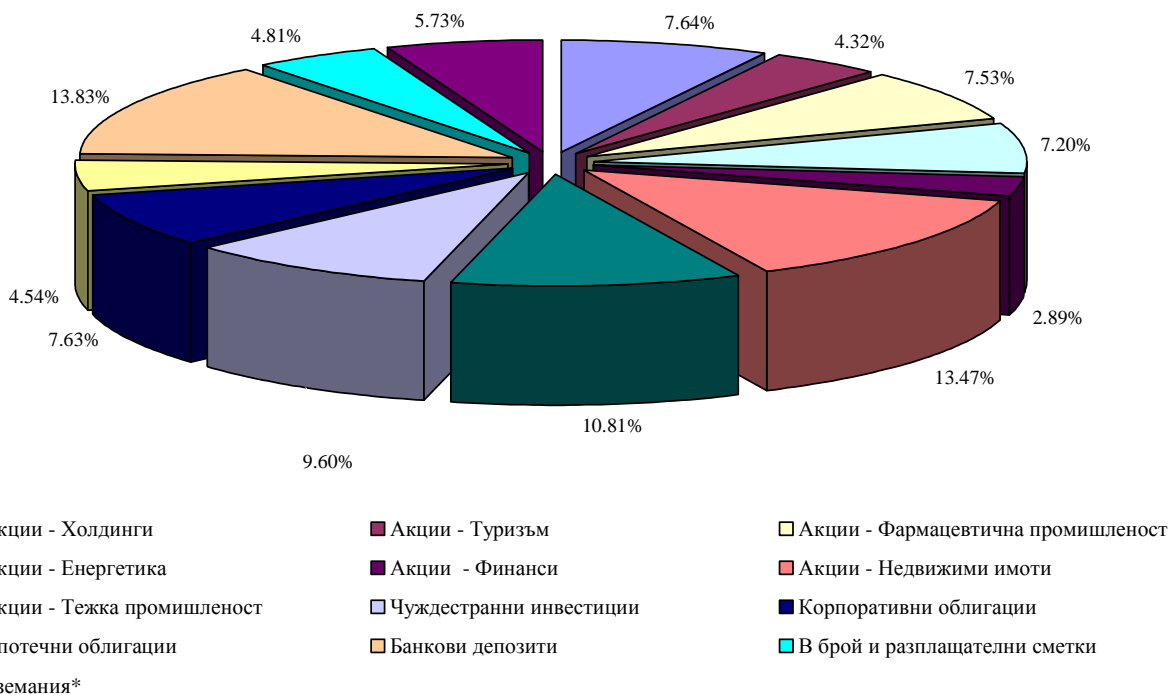
1) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31.12.2012г. 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 31/12/2012		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	142 234	7.64%
Акции - Туризм	80 446	4.32%
Акции - Фармацевтична промишленост	140 182	7.53%
Акции - Енергетика	134 031	7.20%
Акции - Финанси	53 876	2.89%
Акции - Недвижими имоти	250 870	13.47%
Акции - Тежка промишленост	201 231	10.81%
Чуждестранни инвестиции	178 665	9.60%
Корпоративни облигации	142 060	7.63%
Ипотечни облигации	84 433	4.54%
Банкови депозити	257 500	13.83%
В брой и разплащателни сметки	89 581	4.81%
Вземания*	106 679	5.73%
Общо активи	1 861 788	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 31/12/2012


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	1 156.060	1.0000	\$1 156.06
Валутно деноминиран актив	USD	437.000	140.0300	\$61 193.11
Валутно деноминиран актив	USD	487.000	121.6300	\$59 233.81
Обща рискова позиция				\$121 582.98

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 93 000.00	1.316305	\$122 416.37	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$122 416.37		

Красимир Петков
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД