

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. Продадени са и чуждестранни инвестиции.

Към 31.03.2013г. 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 31.03.2013г. възлиза на 56.42%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 4.62% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.03.2013г. корпоративните облигации представляват 7.24% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик, а ипотечните облигации 3.94% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 13.56% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.03.2013г. са 8.67% от стойността на портфейла.

Вземанията от лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации и платени такси към БФБ и КФН възлизат на 5.55% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.03.2013 г. е минус 2.61% на годишна база*. Доходността от началото на годината е 5.07% , а доходността за последните 12 месеца към 29.03.2013г. е 5.14%.

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

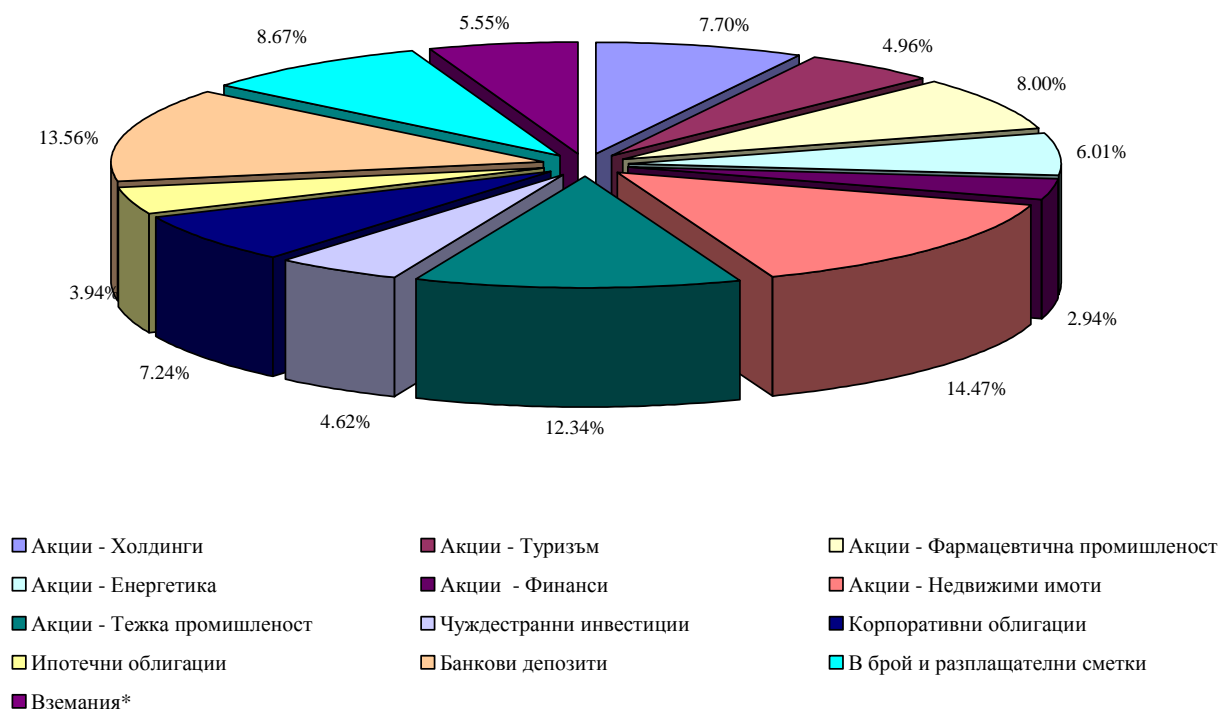
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31.03.2013г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 31/03/2013

Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	148 790	7.70%
Акции - Туризм	95 850	4.96%
Акции - Фармацевтична промишленост	154 482	8.00%
Акции - Енергетика	116 137	6.01%
Акции - Финанси	56 893	2.94%
Акции - Недвижими имоти	279 570	14.47%
Акции - Тежка промишленост	238 353	12.34%
Чуждестранни инвестиции	89 187	4.62%
Корпоративни облигации	139 987	7.24%
Ипотечни облигации	76 048	3.94%
Банкови депозити	261 956	13.56%
В брой и разплащателни сметки	167 476	8.67%
Вземания*	107 209	5.55%
Общо активи	1 931 938	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/03/2013


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	69 090.480	1.0000	\$69 090.48
Валутно деноминиран актив	USD	487.000	119.9000	\$58 391.30
Обща рискова позиция				\$127 481.78

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 93 000.00	1.295570	\$120 488.01	ОТС	България
Обща хеджираща позиция				\$120 488.01		

Красимир Петков
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД