

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 са продадени корпоративни облигации, през периода са продадени и ипотечни облигации.

Към 31.01.2012г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик са разпределени в 10 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 31.01.2012г. възлиза на 56.27%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 9.67% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.01.2012г. корпоративните облигации представляват 16.65% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик, а ипотечните облигации 4.08% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 11.14% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.01.2012г. са 2.08% от стойността на портфейла.

Вземанията от хеджиране и предварително платени такси към БФБ възлизат на 0.11% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.01.2012г. е минус 3.40% на годишна база*. Доходността от началото на годината е 0.03%, а доходността за последните 12 месеца към 31.01.2012г. е минус 8.61%.

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

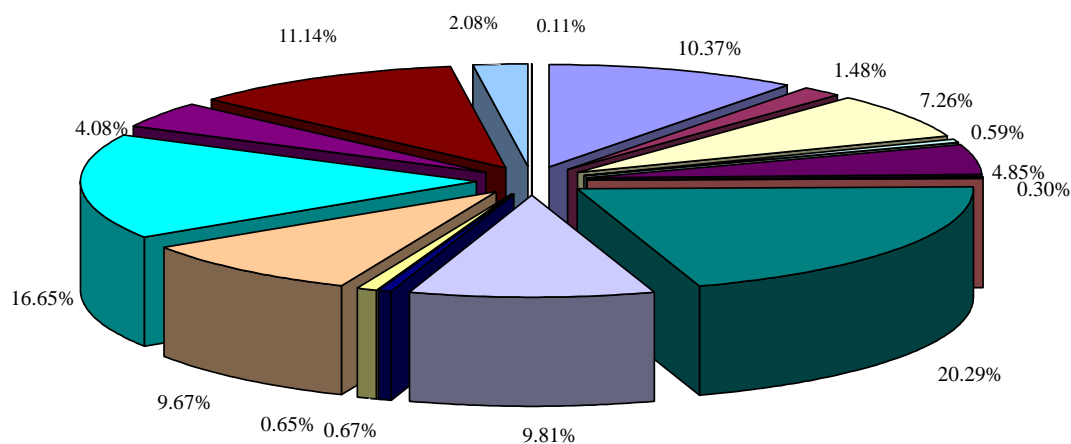
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31.01.2012г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 31/01/2012

Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	215 958	10.37%
Акции - Тютюнева промишленост	30 756	1.48%
Акции - Туризм	151 174	7.26%
Акции - Фармацевтична промишленост	12 229	0.59%
Акции - Енергетика	100 955	4.85%
Акции - Финанси	6 320	0.30%
Акции - Недвижими имоти	422 706	20.29%
Акции - Тежка промишленост	204 301	9.81%
Акции - Лека промишленост	13 944	0.67%
Акции - Медии	13 643	0.65%
Чуждестранни инвестиции	201 503	9.67%
Корпоративни облигации	346 946	16.65%
Ипотечни облигации	84 917	4.08%
Банкови депозити	232 003	11.14%
В брой и разплащателни сметки	43 345	2.08%
Вземания*	2 552	0.11%
Общо активи	2 083 252	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 31/01/2012


- | | | |
|------------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|
| Акции - Холдинги | Акции - Тютюнева промишленост | 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

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, 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	336.460	1.0000	\$336.46
Валутно деноминиран актив	USD	1 665.000	32.0331	\$53 335.11

Обща рискова позиция	\$53 671.57
-----------------------------	-------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 43 000.00	1.27934	\$55 011.62	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$55 011.62		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД