

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.

Към 28.02.2013г. 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 28.02.2013г. възлиза на 55.40%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 9.77% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 28.02.2013г. корпоративните облигации представляват 7.43% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик, а ипотечните облигации 3.97% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 13.67% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 28.02.2013г. са 4.07% от стойността на портфейла.

Вземанията от лихвено и главнично плащане по емисия корпоративни облигации и платени такси към БФБ и КФН възлизат на 5.69% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 28.02.2013 г. е минус 2.88% на годишна база*. Доходността от началото на годината е 3.12% , а доходността за последните 12 месеца към 28.02.2013г. е 4.58%.

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

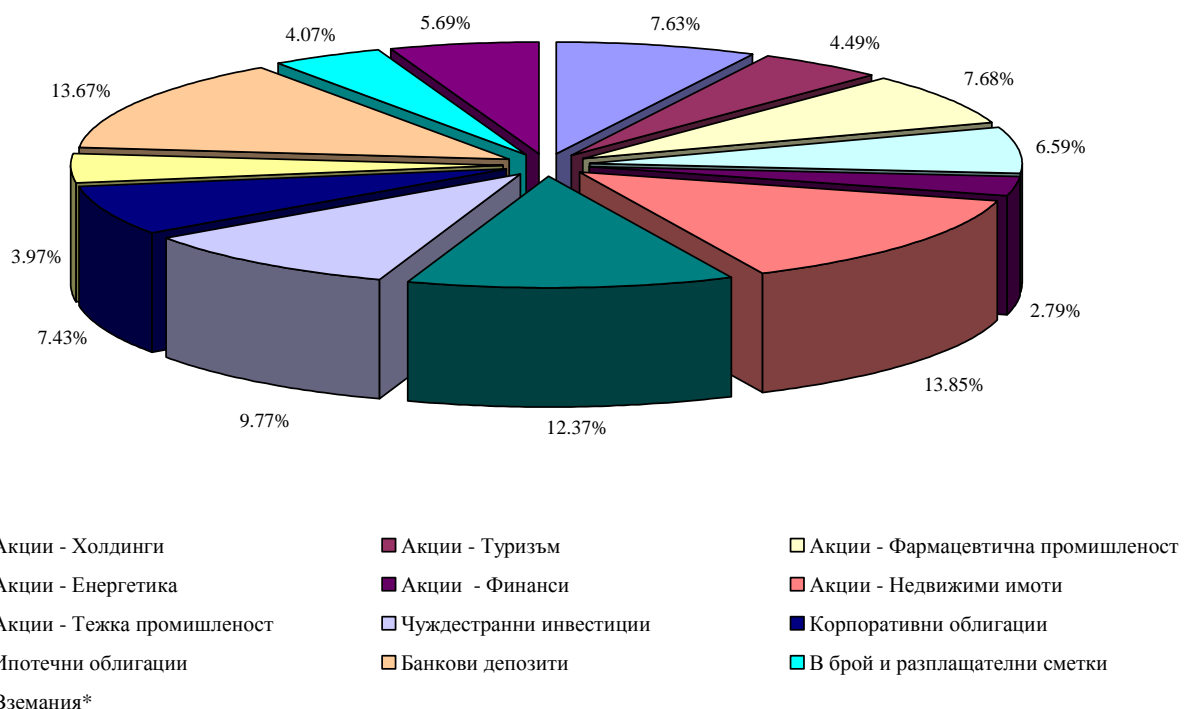
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 28.02.2013г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 28/02/2013

Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	145 187	7.63%
Акции - Туризм	85 425	4.49%
Акции - Фармацевтична промишленост	146 233	7.68%
Акции - Енергетика	125 458	6.59%
Акции - Финанси	53 206	2.79%
Акции - Недвижими имоти	263 713	13.85%
Акции - Тежка промишленост	235 586	12.37%
Чуждестранни инвестиции	185 995	9.77%
Корпоративни облигации	141 432	7.43%
Ипотечни облигации	75 576	3.97%
Банкови депозити	260 399	13.67%
В брой и разплащателни сметки	77 521	4.07%
Вземания*	108 331	5.69%
Общо активи	1 904 062	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 28/02/2013


- Акции - Холдинги
- Акции - Туризм
- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Енергетика
- Акции - Финанси
- Акции - Недвижими имоти
- Акции - Тежка промишленост
- 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	1 710.300	1.0000	\$1 710.30
Валутно деноминиран актив	USD	487.000	120.3300	\$58 600.71
Валутно деноминиран актив	USD	437.000	151.6100	\$66 253.57
Обща рискова позиция				\$126 564.58

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 93 000.00	1.339450	\$124 568.85	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$124 568.85		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД