

**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 продажбите на акции от български публични дружества, търгувани на БФБ – София АД. През периода са закупени и корпоративни облигации.

Към 30.06.2012г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик са разпределени в 8 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 30.06.2012г. възлиза на 42.22%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 13.60% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 30.06.2012г. корпоративните облигации представляват 12.44% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик, а ипотечните облигации 4.45% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 13.11% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.06.2012г. са 12.26% от стойността на портфейла.

Вземанията от начислени дивиденди, лихвено плащане по емисия корпоративни облигации, хеджиране, както и от предварително платени такси към БФБ възлизат на 1.92% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.06.2012г. е минус 3.93% на годишна база*. Доходността от началото на годината е минус 4.99%, а доходността за последните 12 месеца към 29.06.2012г. е минус 14.48%.

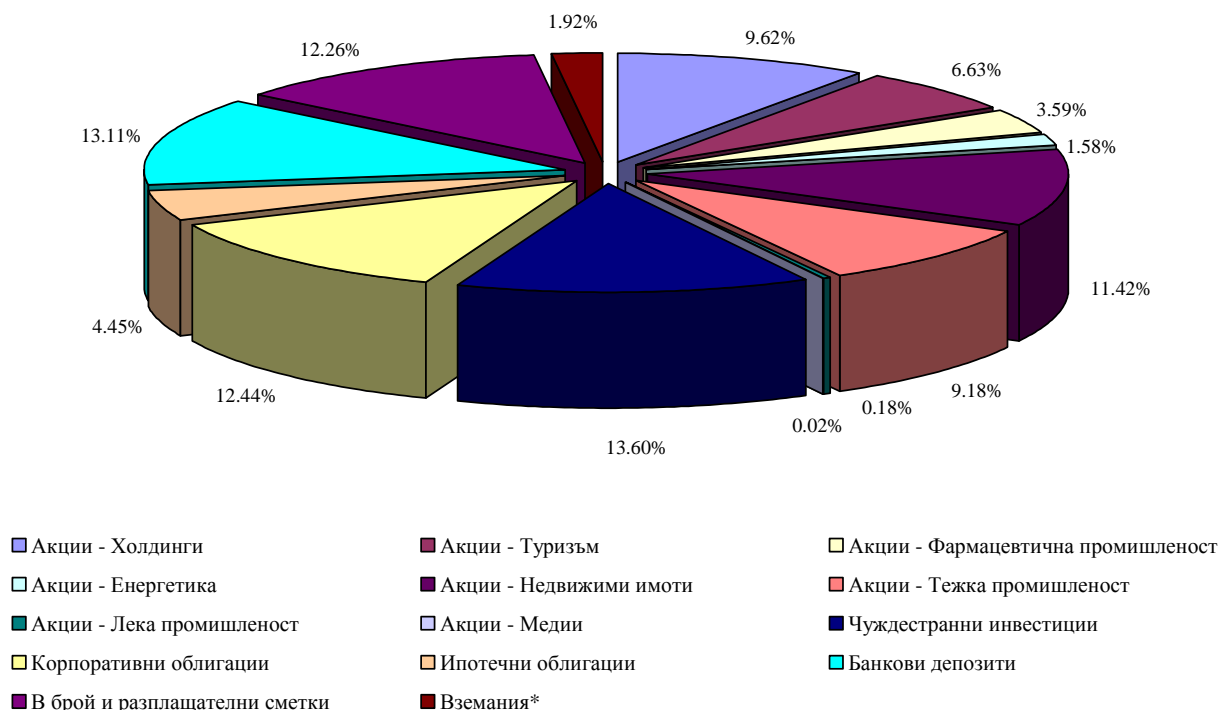
I. Данни по чл. 72, ал. 2 от Наредба № 44

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 30.06.2012г. 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 30/06/2012		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	182 367	9.62%
Акции - Туризм	125 866	6.63%
Акции - Фармацевтична промишленост	68 236	3.59%
Акции - Енергетика	29 915	1.58%
Акции - Недвижими имоти	216 843	11.42%
Акции - Тежка промишленост	174 121	9.18%
Акции - Лека промишленост	3 405	0.18%
Акции - Медии	361	0.02%
Чуждестранни инвестиции	258 141	13.60%
Корпоративни облигации	236 043	12.44%
Ипотечни облигации	84 395	4.45%
Банкови депозити	248 670	13.11%
В брой и разплащателни сметки	232 664	12.26%
Вземания*	36 470	1.92%
Общо активи	1 897 497	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 30/06/2012


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

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 по чл. 38, ал. 1, т. 6 от ЗДКИСДПКИ, 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	130 345.830	1.0000	\$130 345.83
Валутно деноминиран актив	USD	527.000	125.8000	\$66 296.60
Валутно деноминиран актив	USD	968.000	64.4900	\$62 426.32
Валутно деноминиран актив	USD	282.000	132.7900	\$37 446.78

Обща рискова позиция	\$296 515.53
-----------------------------	---------------------

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 229 000.00	1.2576	\$287 985.82	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$287 985.82		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД