

**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 продадени и ипотечни облигации.

Към 31.01.2013г. 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 31.01.2013г. възлиза на 56.41%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 9.18% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.01.2013г. корпоративните облигации представляват 7.33% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик, а ипотечните облигации 3.86% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 13.32% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.01.2013г. са 4.23% от стойността на портфейла.

Вземанията от хеджиране, лихвено и главнично плащане по емисия корпоративни облигации и платени такси към БФБ и КФН възлизат на 5.67% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.01.2013 г. е минус 2.63% на годишна база*. Доходността от началото на годината е 5.33% , а доходността за последните 12 месеца към 31.01.2013г. е 2.44%.

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**

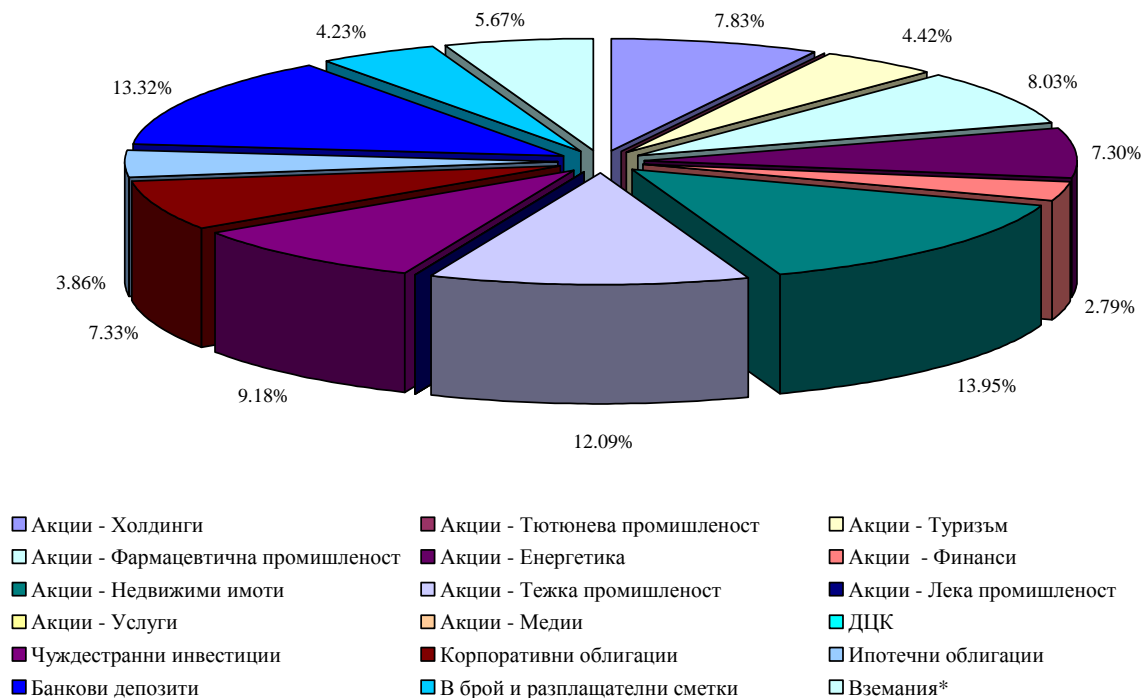
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31.01.2013г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 31/01/2013		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	152 142	7.83%
Акции - Туризм	85 914	4.42%
Акции - Фармацевтична промишленост	156 088	8.03%
Акции - Енергетика	141 896	7.30%
Акции - Финанси	54 256	2.79%
Акции - Недвижими имоти	271 095	13.95%
Акции - Тежка промишленост	235 088	12.09%
Чуждестранни инвестиции	178 373	9.18%
Корпоративни облигации	142 427	7.33%
Ипотечни облигации	75 120	3.86%
Банкови депозити	258 992	13.32%
В брой и разплащателни сметки	82 319	4.23%
Вземания*	110 167	5.67%
Общо активи	1 943 877	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/01/2013



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	1 588.080	1.0000	\$1 588.08
Валутно деноминиран актив	USD	487.000	119.4200	\$58 157.54
Валутно деноминиран актив	USD	437.000	149.7000	\$65 418.90
Обща рискова позиция				\$125 164.52

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 93 000.00	1.328730	\$123 571.89	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$123 571.89		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД