

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 закупени и чуждестранни инвестиции.

Към 30.11.2012г. 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 30.11.2012г. възлиза на 53.82%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 9.87% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 30.11.2012г. корпоративните облигации представляват 7.53% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик, а ипотечните облигации 4.71% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 13.80% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.11.2012г. са 4.07% от стойността на портфейла.

Вземанията от хеджиране, лихвено и главнично плащане по емисия корпоративни облигации, както и от предварително платени такси към БФБ и КФН възлизат на 6.20% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.11.2012г. е минус 3.68% на годишна база*. Доходността от началото на годината е минус 4.81%, а доходността за последните 12 месеца към 30.11.2012г. е минус 4.96%.

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

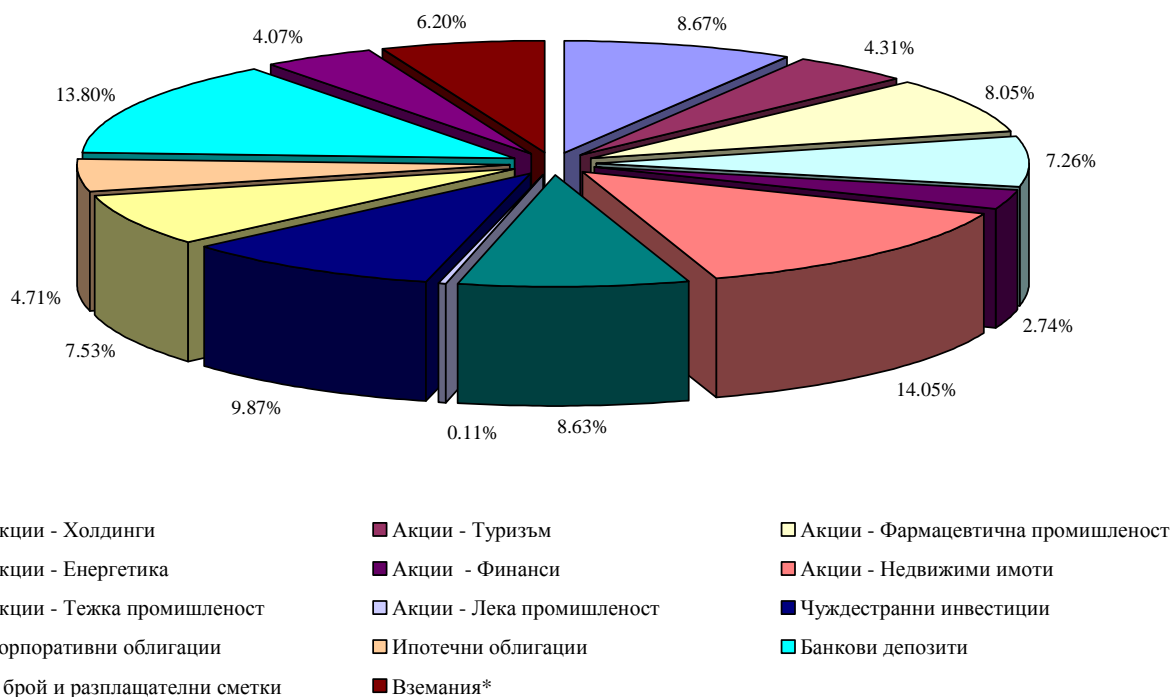
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 30.11.2012г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 30/11/2012		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	160 627	8.67%
Акции - Туризм	79 911	4.31%
Акции - Фармацевтична промишленост	149 397	8.05%
Акции - Енергетика	134 532	7.26%
Акции - Финанси	50 788	2.74%
Акции - Недвижими имоти	260 783	14.05%
Акции - Тежка промишленост	159 990	8.63%
Акции - Лека промишленост	2 029	0.11%
Чуждестранни инвестиции	183 142	9.87%
Корпоративни облигации	139 559	7.53%
Ипотечни облигации	87 336	4.71%
Банкови депозити	256 018	13.80%
В брой и разплащателни сметки	75 486	4.07%
Вземания*	115 060	6.20%
Общо активи	1 854 658	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 30/11/2012



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

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	33 940.910	1.0000	\$33 940.91
Валутно деноминиран актив	USD	437.000	142.1550	\$62 121.74
Валутно деноминиран актив	USD	487.000	122.1300	\$59 477.31
Обща рискова позиция				\$155 539.96

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 128 000.00	1.27522	\$163 228.16	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$163 228.16		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД