

**ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО  
ЧЛ. 75 т.2 ОТ НАРЕДБА № 44 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА  
КОЛЕКТИВНИТЕ ИНВЕСТИЦИОННИ СХЕМИ, ИНВЕСТИЦИОННИТЕ  
ДРУЖЕСТВА ОТ ЗАТВОРЕН ТИП И УПРАВЛЯВАЩИТЕ ДРУЖЕСТВА**

**ДОГОВОРЕН ФОНД „ТИ БИ АЙ ДИНАМИК“**

**I. Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5 от Наредба № 44, във връзка с чл.75, т.2**

**1) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5, б. „г“: Промени в структурата на портфейла през отчетния период**

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 чуждестранни инвестиции и са падежирали ипотечни облигации.

Към 30.06.2013г. 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 30.06.2013г. възлиза на 52.16%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 7.43% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 30.06.2013г. корпоративните облигации представляват 6.50% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Банковите депозити съставляват 15.41% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.06.2013г. са 12.63% от стойността на портфейла.

Вземанията от лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, начислени дивиденди и платени такси към БФБ и КФН възлизат на 5.87% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 28.06.2013 г. е минус 1.81% на годишна база\*. Доходността от началото на годината е 11.29% , а доходността за последните 12 месеца към 28.06.2013г. е 14.20%.

\* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

**2) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б. „а“ и „д“: Промени в състоянието на активите в рамките на отчетния период**

Долната таблица представя приходите на Фонда към 30.06.2013г. Приходите са в размер на 975 146 лв., включващи приходи от операции с финансови активи, приходи от лихви и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лева		
	30/06/12	31/12/12	30/06/13
Приходи от лихви	22 095	41 031	18 540
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	748 599	1 479 088	819 975
Положителни курсови разлики	172 275	356 492	105 001
Други финансови приходи	33 977	44 816	31 630
<b>Общо приходи:</b>	<b>976 946</b>	<b>1 921 427</b>	<b>975 146</b>

Разходите на Фонда за отчетния период са представени в таблицата по-долу:

Разходи	Стойност в лева		
	30/06/12	31/12/12	30/06/13
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	883 411	1 577 199	640 867
Отрицателни курсови разлики	172 888	356 888	105 651
Разходи за външни услуги	21 750	42 337	20 741
Други финансови разходи	1 924	3 657	817
<b>Общо разходи:</b>	<b>1 079 973</b>	<b>1 980 081</b>	<b>768 076</b>

Общият размер на разходите на фонда към 30.06.2013г. е 768 076 лева, които включват 640 867 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти, 105 651 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество  
 - към 30.06.2013г. – 17 142 лв.  
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0,88%

- б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество  
 - към 30.06.2013г. – 273 лв.  
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.02%

- в) Възнаграждение на банката депозитар  
 - към 30.06.2013г. – 1 200 лв.  
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.06%

г) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие

- към 30.06.2013г. – 1 800 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.09%

д) Други разходи

- към 30.06.2013г. – 1 143 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.06%

- Други разходи по финансови операции: 544 лв.

- Външни услуги (КФН, БФБ, ЦД и други услуги): 599 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 21 558 лв. към месец юни 2013. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 1,11%.

	Стойност в лева		
	30/06/12	31/12/12	30/06/13
Общо Приходи	976 946	1 921 427	975 146
Общо Разходи	1 079 973	1 980 081	768 076
<b>Нетен Резултат</b>	<b>(103 027)</b>	<b>(58 654)</b>	<b>207 070</b>

За периода няма записани и са обратно изкупени 4 145,4029 броя дялове. НСА на фонда към 30.06.2012г. е 1 891 311,35 лв., към 31.12.2012 г. е 1 855 809,75 лв., а към 30.06.2013г. е 2 029 277,51 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 233 488, 3095.

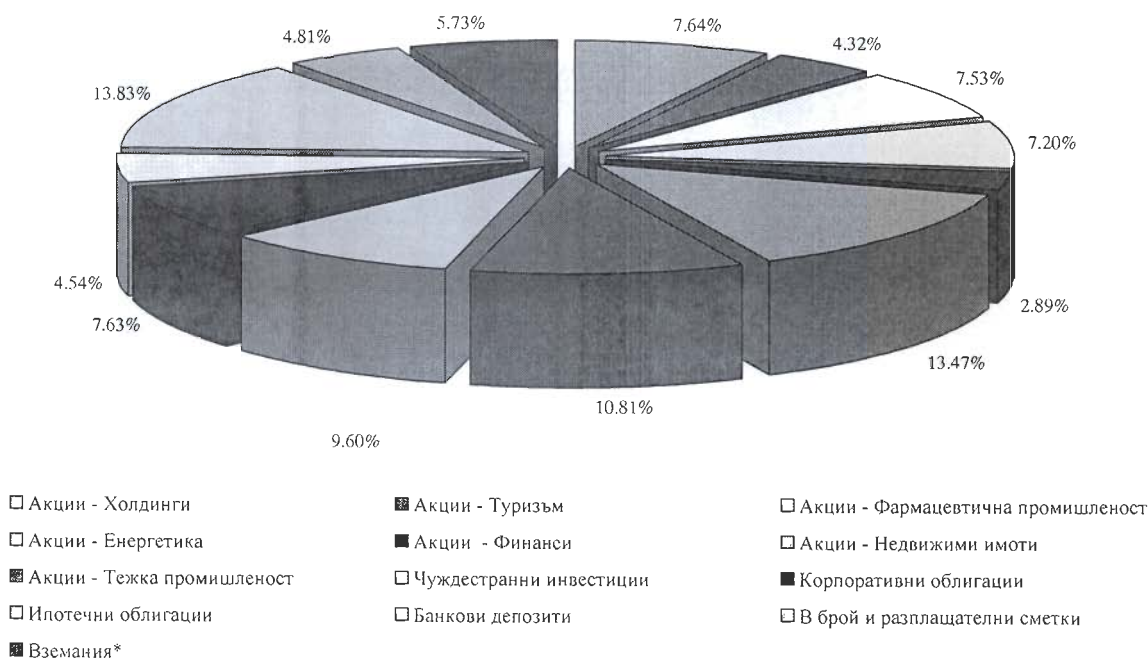
### 3) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б. „в“ и „г“: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик в края на периода е представена в следната таблица и графика.

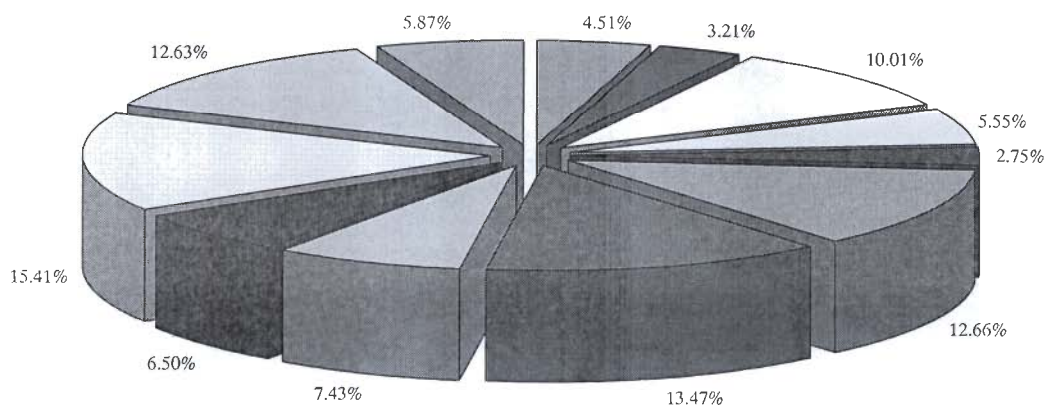
**Структура на портфейла на ДФ "Ти Би Ай Динамик"**

Актив	Стойност в лева 31.12.2012	Процент от активите 31.12.2012	Стойност в лева 30.06.2013	от активите 30.06.2013	Валута (BGN, USD, EUR)
Акции - Холдинги	142 234	7.64%	91 928	4.51%	BGN
Акции - Туризм	80 446	4.32%	65 473	3.21%	BGN
Акции - Фармацевтична промишленост	140 182	7.53%	204 084	10.01%	BGN
Акции - Енергетика	134 031	7.20%	113 040	5.55%	BGN
Акции - Финанси	53 876	2.89%	56 010	2.75%	BGN
Акции - Недвижими имоти	250 870	13.47%	258 132	12.66%	BGN
Акции - Тежка промишленост	201 231	10.81%	274 624	13.47%	BGN
Чуждестранни инвестиции	178 665	9.60%	151 361	7.43%	USD, EUR
Корпоративни облигации	142 060	7.63%	132 484	6.50%	EUR
Ипотечни облигации	84 433	4.54%	0	0.00%	EUR
Банкови депозити	257 500	13.83%	314 077	15.41%	EUR
В брой и разплащателни сметки	89 581	4.81%	257 535	12.63%	USD, EUR, BGN
Вземания*	106 679	5.73%	119 648	5.87%	BGN, EUR
Общо активи	1 861 788	100.00%	2 038 396	100.00%	USD, EUR, BGN

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 31/12/2012**


Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 30/06/2013



- |                              |                                 |                                      |
|------------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| ■ Акции - Холдинги           | ■ Акции - Туризъм               | □ Акции - Фармацевтична промишленост |
| □ Акции - Енергетика         | ■ Акции - Финанси               | □ Акции - Недвижими имоти            |
| ■ Акции - Тежка промишленост | □ Чуждестранни инвестиции       | ■ Корпоративни облигации             |
| □ Банкови депозити           | □ В брой и разплащателни сметки | □ Вземания*                          |

#### 4) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б. „б“: Нетна стойност на активите на един дял

Към 30.06.2012г. нетна стойност на активите на един дял е 7,6268 лв. На 31.12.2012г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 7,8095 лв. Към 30.06.2013г. нетната стойност на активите на един дял е 8,6911 лв.

Изменението на нетната стойност на активите на Фонда е представено на следващата графика.



**5) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5, б. „е“: Сравнителна таблица за последните три периода, включваща общата стойност на нетните активи и нетна стойност на един дял**

	30/06/2012 (лв)	31/12/2012 (лв)	30/06/2013 (лв)
Нетна стойност на активите на „ТИ БИ АЙ Динамик“	1 891 311,35	1 855 809,75	2 029 277,51
Нетна стойност на активите на един дял	7,6268	7,8095	8,6911

**6) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5, б. „ж“: задължения, възникнали от сделки 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
Парични средства във валута	USD	59 024.900	1.0000	\$59 024.90
US78462F1030	USD	329.000	160.420	\$52 778.18
US9229085538	USD	705.000	68.720	\$48 447.60
Обща рискова позиция				\$160 250.68

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форурд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 123 000.00	1.336400	\$164 377.20	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$164 377.20		

Красимир Петков  
 Изпълнителен директор  
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД




Иван Балтов  
 Изпълнителен директор  
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

