

**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/или продажбите на акции от български публични дружества и облигации, търгувани на БФБ – София АД, както и на чуждестранни инвестиции.

Към 30.06.2012г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик са разпределени в 8 икономически сектора. Техният дял от активите на Фонда възлиза на 42,22%.

Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 30.06.2012г. възлизат на 13,60% от активите на Фонда.

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.

Корпоративните облигации представляват 12,44% от активите на Фонда, докато дела на ипотечните облигации представлява 4,45%.

Вземанията във връзка с 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%.

* 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

За периода няма записани и са обратно изкупени 31 705,0393 броя дялове. НСА на фонда към 31.12.2011г. е 2 245 082,33 лв., а към 30.06.2012г. е 1 891 311,35 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 247 982,0780.

Долната таблица представя приходите на Фонда към 30.06.2012г. Приходите са в размер на 976 946 лв., включващи приходи от операции с финансови активи, приходи от лихви и други финансови приходи.

Приходи			
	30/06/2011	31/12/2011	30/06/2012
Приходи от лихви	10 313	35 110	22 095
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	1 685 019	2 862 505	748 599
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	286 909	365 363	172 275
Други финансови приходи	10 743	66 750	33 977
Общо приходи	1 992 984	3 329 728	976 946

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

Разходи			
	30/06/2011	31/12/2011	30/06/2012
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	1 563 980	3 075 871	883 411
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	284 489	362 609	172 888
Други разходи	2 708	4 857	1 924
Разходи за външни услуги	28 682	56 197	21 750
Общо разходи	1 879 859	3 499 534	1 079 973

Общият размер на разходите на фонда към 30.06.2012г. е 1 079 973 лева, които включват 883 411 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти, 172 888 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество
 - към 30.06.2012г. – 17 760 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0,8912%

- б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество
 - към 30.06.2012г. – 917 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.0460%

- в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 30.06.2012г. – 1 200 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.0602%

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

- към 30.06.2012г.– 2 190 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.1099%

д) Други разходи

- към 30.06.2012г. – 1 607 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.0806%

- Други разходи по финансови операции: 1 007 лв.
- Външни услуги (КФН, БФБ , ЦД и други услуги): 600 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 23 674 лв. към месец юни 2012. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 1,1880%.

	30/06/2011	31/12/2011	30/06/2012
Общо Приходи	1 992 984	3 329 728	976 946
Общо Разходи	1 879 859	3 499 534	1 079 973
Нетен Резултат	113 125	-169 806	-103 027

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.

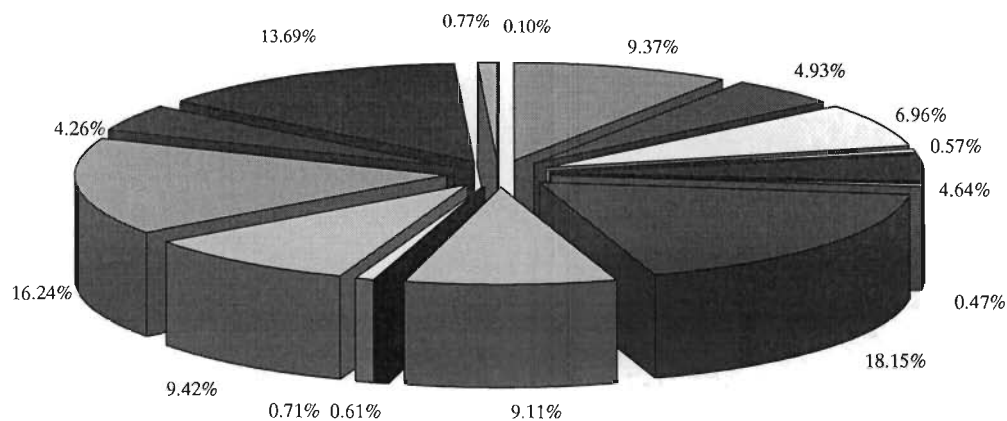


Структура на портфейла на ДФ "Ти Би Ай Динамик"

Актив	Стойност в лева 31.12.2011	Процент от активите 31.12.2011	Стойност в лева 30.06.2012	от активите 30.06.2012	Валута (BGN, USD, EUR)
Акции - Холдинги	211 204	9.37%	182 367	9.62%	BGN
Акции - Тютюнева промишленост	111 216	4.93%			BGN
Акции - Туризм	156 905	6.96%	125 866	6.63%	BGN
Акции - Фармацевтична промишленост	12 901	0.57%	68 236	3.59%	BGN
Акции - Енергетика	104 723	4.64%	29 915	1.58%	BGN
Акции - Финанси	10 662	0.47%			BGN
Акции - Недвижими имоти	409 218	18.15%	216 843	11.42%	BGN
Акции - Тежка промишленост	205 319	9.11%	174 121	9.18%	BGN
Акции - Лека промишленост	13 805	0.61%	3 405	0.18%	BGN
Акции - Медии	16 053	0.71%	361	0.02%	BGN
Чуждестранни инвестиции	212 375	9.42%	258 141	13.60%	USD, EUR
Корпоративни облигации	366 146	16.24%	236 043	12.44%	EUR
Ипотечни облигации	96 021	4.26%	84 395	4.45%	EUR
Банкови депозити	308 645	13.69%	248 670	13.11%	EUR
В брой и разплащателни сметки	17 331	0.77%	232 664	12.26%	USD, EUR, BGN
Вземания*	2 085	0.10%	36 470	1.92%	BGN, EUR
Общо активи	2 254 610	100.00%	1 897 497	100.00%	USD, EUR, BGN

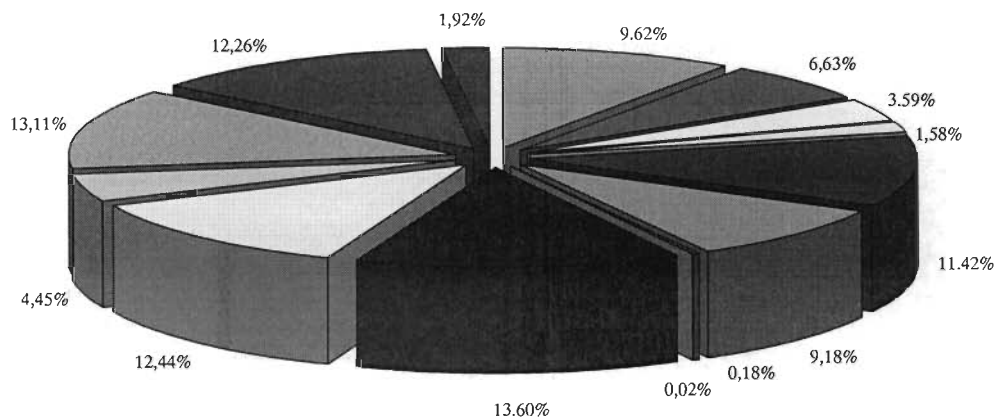
Вземания във връзка с начислени дивиденди, лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, предварително платени такси към БФБ и КФН, вземания от хеджиране и др.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/12/2011



- Акции - Холдинги
- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Недвижими имоти
- Акции - Медии
- Ипотечни облигации
- Вземания*
- Акции - Тютюнева промишленост
- Акции - Енергетика
- Акции - Тежка промишленост
- Чуждестранни инвестиции
- Банкови депозити
- Акции - Туризм
- Акции - Финанси
- Акции - Лека промишленост
- Корпоративни облигации
- В брой и разплащателни сметки

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 30/06/2012



- | | | |
|---------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|
| ■ Акции - Холдинги | ■ Акции - Туризм | □ Акции - Фармацевтична промишленост |
| □ Акции - Енергетика | ■ Акции - Недвижими имоти | ■ Акции - Тежка промишленост |
| ■ Акции - Лека промишленост | □ Акции - Медии | ■ Чуждестранни инвестиции |
| □ Корпоративни облигации | □ Ипотечни 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

На 30.06.2011г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 8,9720лв. На 31.12.2011г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 8,0271лв.. Към 30.06.2012г. нетната стойност на активите на един дял е 7,6268лв.

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



[Signature]
Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

[Signature]
Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

