

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.

Към 28.02.2015г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик са разпределени в 6 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 28.02.2015г. възлиза на 27.62%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 36.56% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 28.02.2015г. корпоративните облигации представляват 4.84% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 28.02.2015г. са 7.69% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии , вземане по договор и платена такса КФН възлизат на 23.29% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 27.02.2015г. е минус 0.90% на годишна база*. Доходността от началото на годината е 2.23%, а доходността за последните 12 месеца към 27.02.2015г. е минус 1.75%.

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

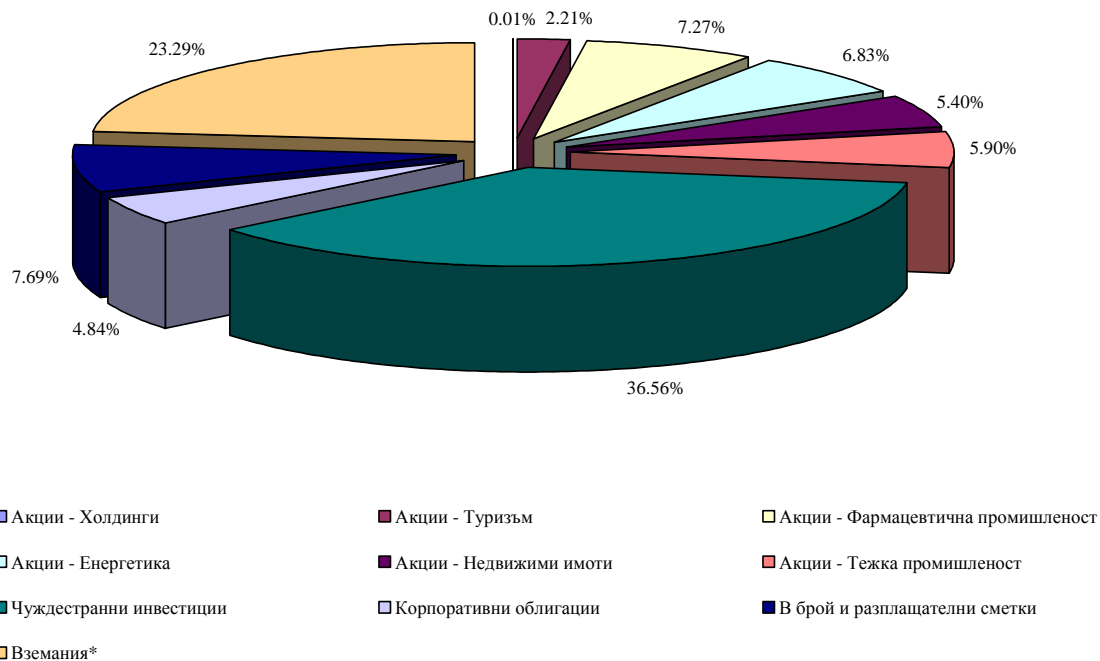
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 28.02.2015г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 28.02.2015 г. | | |
|---|-----------------|---------------------|
| Актив | Стойност в лева | Процент от активите |
| Акции - Холдинги | 246 | 0.01% |
| Акции - Туризмъ | 38 524 | 2.21% |
| Акции - Фармацевтична промишленост | 126 695 | 7.27% |
| Акции - Енергетика | 119 001 | 6.83% |
| Акции - Недвижими имоти | 94 143 | 5.40% |
| Акции - Тежка промишленост | 102 793 | 5.90% |
| Чуждестранни инвестиции | 636 786 | 36.56% |
| Корпоративни облигации | 84 255 | 4.84% |
| В брой и разплащателни сметки | 133 923 | 7.69% |
| Вземания* | 405 678 | 23.29% |
| Общо активи | 1 742 044 | 100.00% |

* Вземания за главница и лихва по облигационни емисии ,вземане по договор и платена такса КФН.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 28/02/2015



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 | 2 479.460 | 1.0000 | \$2 479.46 |
| Валутно деноминиран актив | USD | 449.000 | 210.660 | \$94 586.34 |
| Валутно деноминиран актив | USD | 570.000 | 108.400 | \$61 788.00 |
| Обща рискова позиция | | | | \$158 853.80 |

| Деривативен инструмент | | | | | | |
|-------------------------------|---------------|--------------|-------------|----------------------|--------------|----------------|
| Вид | Валута | Брой | Цена | Обща Стойност | Пазар | Държава |
| Форуърд купува EUR/USD | EUR/USD | € 113 500.00 | 1.133210 | \$128 619.34 | OTC | България |
| Обща хеджираща позиция | | | | \$128 619.34 | | |

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД