



**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. Закупени са и чуждестранни инвестиции.

Към 31.05.2015г. 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 31.05.2015г. възлиза на 28.36%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 43.31% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.05.2015г. корпоративните облигации представляват 5.05% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.05.2015г. са 10.08% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, вземане по договор и платена такса КФН възлизат на 13.20% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.05.2015г. е минус 1.26% на годишна база\*. Доходността от началото на годината е минус 1.53%, а доходността за последните 12 месеца към 29.05.2015г. е минус 7.44%.

**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 31.05.2015г. е представена в следната таблица и графика.

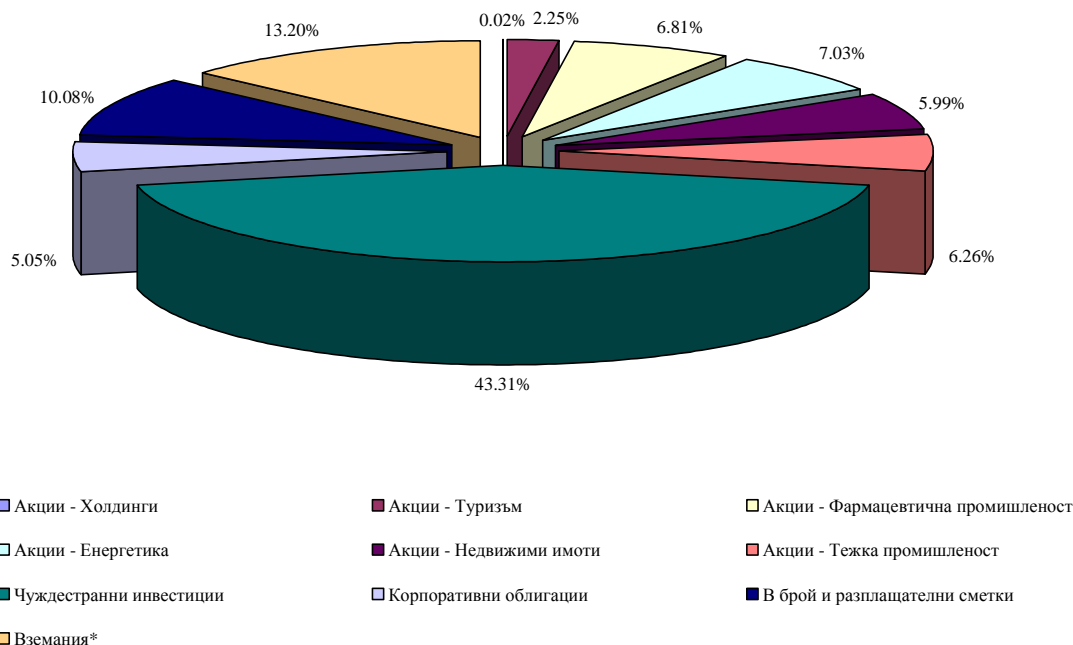
\* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.



Структура на портфейла на ДФ "Ти Би Ай Динамик" към 31.05.2015 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	253	0.02%
Акции - Туризм	37 208	2.25%
Акции - Фармацевтична промишленост	112 667	6.81%
Акции - Енергетика	116 369	7.03%
Акции - Недвижими имоти	99 055	5.99%
Акции - Тежка промишленост	103 593	6.26%
Чуждестранни инвестиции	716 729	43.31%
Корпоративни облигации	83 621	5.05%
В брой и разплащателни сметки	166 783	10.08%
Вземания*	218 495	13.20%
Общо активи	1 654 773	100.00%

\* Вземания във връзка с главница и лихва по облигационни емисии, платени такси към КФН и вземания по договор.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/05/2015





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	13 135.920	1.0000	\$13 135.92
Валутно деноминиран актив	USD	400.000	211.140	\$84 456.00
Валутно деноминиран актив	USD	570.000	110.050	\$62 728.50
Обща рискова позиция				\$160 320.42

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 144 000.00	1.125670	\$162 096.48	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$162 096.48		

Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ди Ви Асет Мениджмънт ЕАД