

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 31.01.2015г. 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 31.01.2015г. възлиза на 29.06%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 34.88% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.01.2015г. корпоративните облигации представляват 4.98% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.01.2015г. са 7.38% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии и вземане по договор възлизат на 23.70% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.01.2015г. е минус 1.10% на годишна база*. Доходността от началото на годината е 0.40%, а доходността за последните 12 месеца към 30.01.2015г. е минус 0.09%.

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

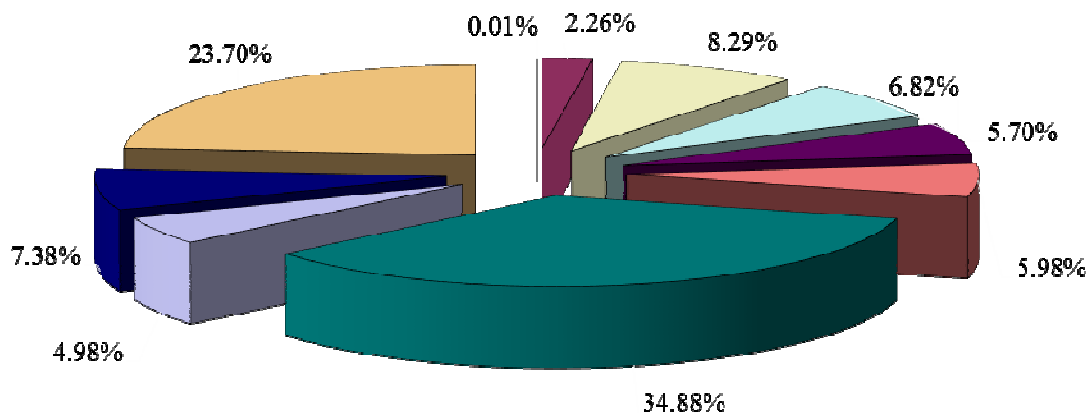
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31.01.2015г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 31.01.2015 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	123	0.01%
Акции - Туризм	38 521	2.26%
Акции - Фармацевтична промишленост	141 467	8.29%
Акции - Енергетика	116 508	6.82%
Акции - Недвижими имоти	97 360	5.70%
Акции - Тежка промишленост	102 104	5.98%
Чуждестранни инвестиции	595 593	34.88%
Корпоративни облигации	85 093	4.98%
В брой и разплащателни сметки	126 003	7.38%
Вземания*	404 618	23.70%
Общо активи	1 707 390	100.00%

* Вземания за главница и лихва по облигационни емисии и вземане по договор.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/01/2015



- | | |
|--------------------------------------|------------------------------|
| ■ Акции - Холдинги | ■ Акции - Туризм |
| ■ Акции - Фармацевтична промишленост | ■ Акции - Енергетика |
| ■ Акции - Недвижими имоти | ■ Акции - Тежка промишленост |
| ■ Чуждестранни инвестиции | ■ Корпоративни облигации |
| ■ В брой и разплащателни сметки | ■ Вземания* |

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	2 482.850	1.0000	\$2 482.85
Валутно деноминиран актив	USD	449.000	199.450	\$89 553.05
Валутно деноминиран актив	USD	570.000	101.100	\$57 627.00
Обща рискова позиция				\$149 662.90

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 113 500.00	1.179000	\$133 816.50	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$133 816.50		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД