

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 31.10.2013г. 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 31.10.2013г. възлиза на 46.10%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 13.59% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.10.2013г. корпоративните облигации представляват 6.74% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Банковите депозити съставляват 16.66% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.10.2013г. са 10.82% 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 6.09% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.10.2013 г. е минус 1.49% на годишна база*. Доходността от началото на годината е 13.55% , а доходността за последните 12 месеца към 31.10.2013г. е 14.20%.

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

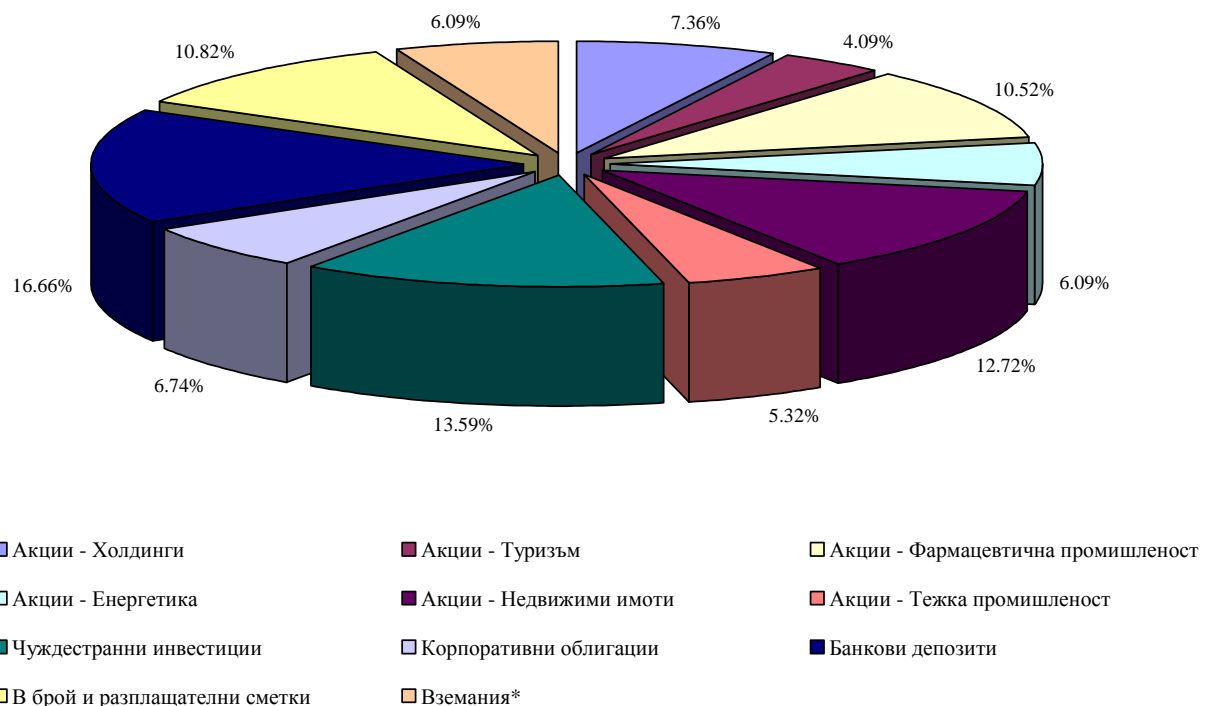
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31.10.2013г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 31.10.2013 г.

Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	142 038	7.36%
Акции - Туризм	78 800	4.09%
Акции - Фармацевтична промишленост	202 825	10.52%
Акции - Енергетика	117 512	6.09%
Акции - Недвижими имоти	245 363	12.72%
Акции - Тежка промишленост	102 498	5.32%
Чуждестранни инвестиции	262 207	13.59%
Корпоративни облигации	130 022	6.74%
Банкови депозити	321 426	16.66%
В брой и разплащателни сметки	208 600	10.82%
Вземания*	117 512	6.09%
Общо активи	1 928 803	100.00%

* Вземания във връзка с начислени дивиденди, лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, платени такси към БФБ и КФН.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/10/2013


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
Парични средства във валута	USD	59 700.200	1.0000	\$59 700.20
US78462F1030	USD	329.000	175.790	\$57 834.91
US9229085538	USD	705.000	69.130	\$48 736.65
Обща рискова позиция				\$166 271.76

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 123 000.00	1.38225	\$170 016.75	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$170 016.75		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД