

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 31.07.2014г. 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 31.07.2014г. възлиза на 36.18%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 26.99% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.07.2014г. корпоративните облигации представляват 4.68% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Банковите депозити съставляват 17.63% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.07.2014г. са 5.23% от стойността на портфейла.

Вземанията от лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, начислени дивиденди, както и платени такси към КФН възлизат на 9.29% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.07.2014 г. е минус 0.80% на годишна база*. Доходността от началото на годината е 3.87%, а доходността за последните 12 месеца към 31.07.2014г. е 6.13%.

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 31.07.2014г. е представена в следната таблица и графика.

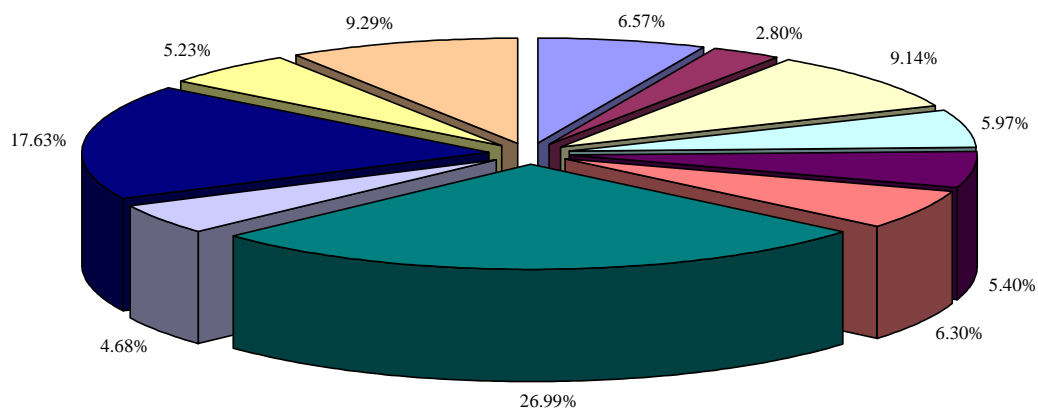
* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

Структура на портфейла на ДФ "Ти Би Ай Динамик" към 31.07.2014 г.

Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	125 309	6.57%
Акции - Туризм	53 343	2.80%
Акции - Фармацевтична промишленост	174 106	9.14%
Акции - Енергетика	113 902	5.97%
Акции - Недвижими имоти	102 964	5.40%
Акции - Тежка промишленост	120 159	6.30%
Чуждестранни инвестиции	514 678	26.99%
Корпоративни облигации	89 200	4.68%
Банкови депозити	336 210	17.63%
В брой и разплащателни сметки	99 761	5.23%
Вземания*	177 044	9.29%
Общо активи	1 906 676	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/07/2014



- Акции - Холдинги
- Акции - Туризм
- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Енергетика
- Акции - Недвижими имоти
- Акции - Тежка промишленост
- Чуждестранни инвестиции
- Корпоративни облигации
- Банкови депозити
- 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	1 604.310	1.0000	\$1 604.31
Валутно деноминиран актив	USD	449.000	193.090	\$86 697.41
Валутно деноминиран актив	USD	570.000	95.020	\$54 161.40
Обща рискова позиция				\$142 463.12

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 104 000.00	1.354380	\$140 855.52	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$140 855.52		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД