

**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 31.08.2014г. 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 31.08.2014г. възлиза на 36.07%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 27.44% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.08.2014г. корпоративните облигации представляват 4.56% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Банковите депозити съставляват 17.34% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.08.2014г. са 6.53% от стойността на портфейла.

Вземанията от лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, начислени дивиденди, както и платени такси към КФН възлизат на 8.06% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.08.2014 г. е минус 0.59% на годишна база\*. Доходността от началото на годината е 5.74%, а доходността за последните 12 месеца към 29.08.2014г. е 8.81%.

**I. Данни по чл. 72, ал. 2 от Наредба № 44**

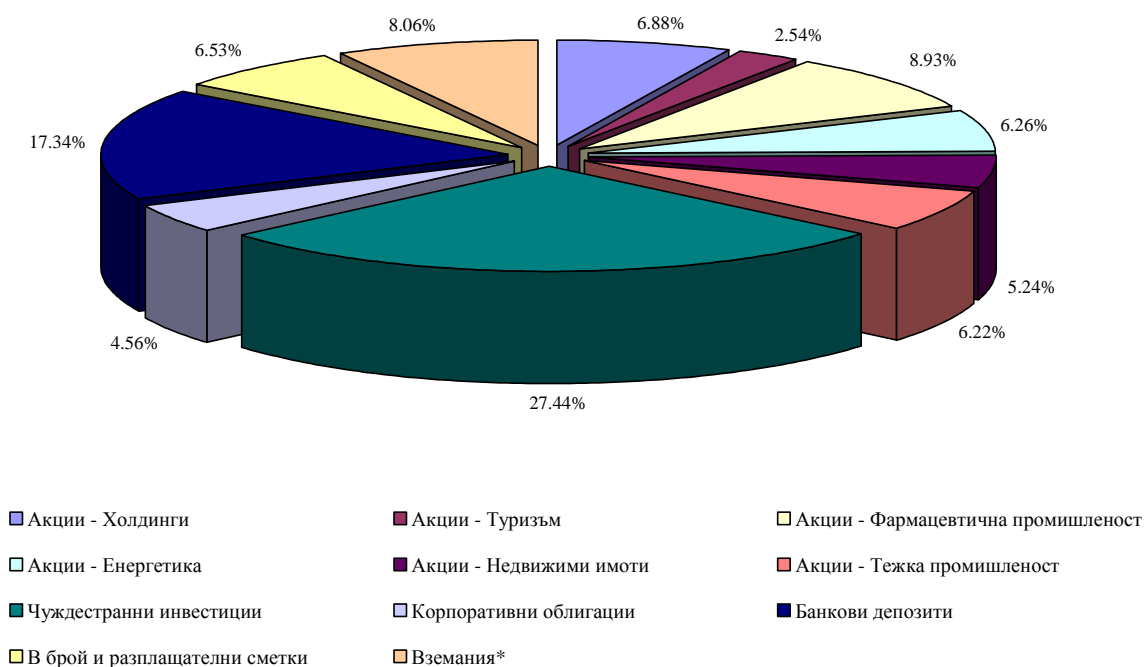
**1) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти**

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31.08.2014г. е представена в следната таблица и графика.

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

<b>Структура на портфейла на ДФ "Ти Би Ай Динамик" към 31.08.2014 г.</b>		
<b>Актив</b>	<b>Стойност в лева</b>	<b>Процент от активите</b>
Акции - Холдинги	133 504	6.88%
Акции - Туризм	49 174	2.54%
Акции - Фармацевтична промишленост	173 215	8.93%
Акции - Енергетика	121 459	6.26%
Акции - Недвижими имоти	101 611	5.24%
Акции - Тежка промишленост	120 612	6.22%
Чуждестранни инвестиции	532 097	27.44%
Корпоративни облигации	88 472	4.56%
Банкови депозити	336 210	17.34%
В брой и разплащателни сметки	126 716	6.53%
Вземания*	156 191	8.06%
<b>Общо активи</b>	<b>1 939 261</b>	<b>100.00%</b>

\* 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 31/08/2014**


**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.

<b>Рисков актив</b>				
<b>ISIN</b>	<b>Валута</b>	<b>Брой</b>	<b>Цена</b>	<b>Обща Стойност</b>
Валутно деноминиран актив	USD	1 600.290	1.0000	\$1 600.29
Валутно деноминиран актив	USD	449.000	200.710	\$90 118.79
Валутно деноминиран актив	USD	570.000	99.780	\$56 874.60
<b>Обща рискова позиция</b>				<b>\$148 593.68</b>

<b>Деривативен инструмент</b>						
<b>Вид</b>	<b>Валута</b>	<b>Брой</b>	<b>Цена</b>	<b>Обща Стойност</b>	<b>Пазар</b>	<b>Държава</b>
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 104 000.00	1.336380	\$138 983.52	OTC	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>				<b>\$138 983.52</b>		

Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД