

**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 на акции от български публични дружества, търгувани на БФБ – София АД.

Към 30.09.2014г. 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 30.09.2014г. възлиза на 35.86%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 28.12% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 30.09.2014г. корпоративните облигации представляват 4.59% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Банковите депозити съставляват 17.49% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.09.2014г. са 6.35% от стойността на портфейла.

Вземанията от лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, начислени дивиденди, както и платени такси към КФН възлизат на 7.59% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.09.2014 г. е минус 0.68% на годишна база\*. Доходността от началото на годината е 4.87%, а доходността за последните 12 месеца към 30.09.2014г. е 6.15%.

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

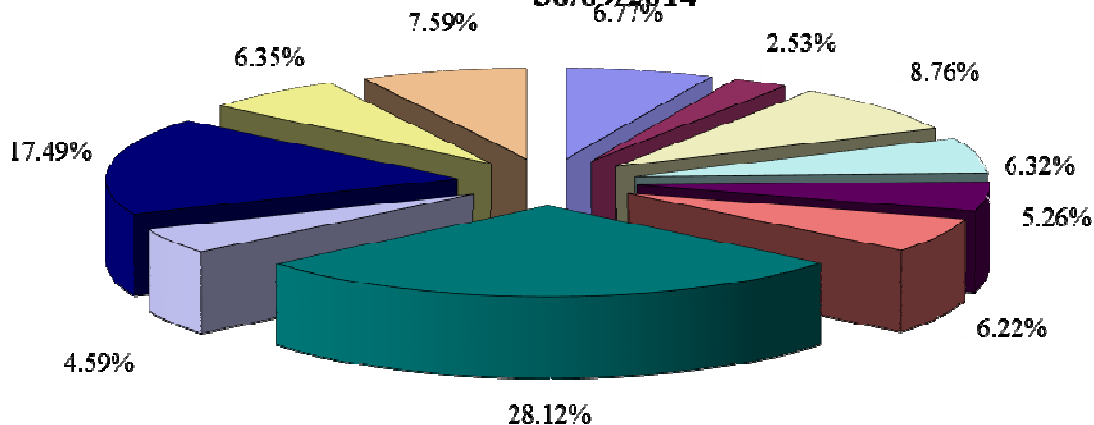
**1) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти**

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 30.09.2014г. 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 30.09.2014 г.</b>		
<b>Актив</b>	<b>Стойност в лева</b>	<b>Процент от активите</b>
<i>Акции - Холдинги</i>	<b>130 139</b>	<b>6.77%</b>
<i>Акции - Туризм</i>	<b>48 681</b>	<b>2.53%</b>
<i>Акции - Фармацевтична промишленост</i>	<b>168 306</b>	<b>8.76%</b>
<i>Акции - Енергетика</i>	<b>121 458</b>	<b>6.32%</b>
<i>Акции - Недвижими имоти</i>	<b>101 105</b>	<b>5.26%</b>
<i>Акции - Тежка промишленост</i>	<b>119 544</b>	<b>6.22%</b>
<i>Чуждестранни инвестиции</i>	<b>540 402</b>	<b>28.12%</b>
<i>Корпоративни облигации</i>	<b>88 280</b>	<b>4.59%</b>
<i>Банкови депозити</i>	<b>336 210</b>	<b>17.49%</b>
<i>В брой и разплащателни сметки</i>	<b>121 983</b>	<b>6.35%</b>
<i>Вземания*</i>	<b>145 823</b>	<b>7.59%</b>
<b>Общо активи</b>	<b>1 921 931</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 30/09/2014



- |                                      |                                 |
|--------------------------------------|---------------------------------|
| ■ 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.

<b>Рисков актив</b>				
<b>ISIN</b>	<b>Валута</b>	<b>Брой</b>	<b>Цена</b>	<b>Обща Стойност</b>
Валутно деноминиран актив	USD	1 596.350	1.0000	\$1 596.35
Валутно деноминиран актив	USD	449.000	197.020	\$88 461.98
Валутно деноминиран актив	USD	570.000	98.790	\$56 310.30
<b>Обща рискова позиция</b>				\$146 368.63

<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	€ 113 500.00	1.294290	\$146 901.92	OTC	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>				\$146 901.92		

Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД