

**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 31.07.2013г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик са разпределени в 7 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 31.07.2013г. възлиза на 43.11%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 7.50% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.07.2013г. корпоративните облигации представляват 6.37% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Банковите депозити съставляват 15.41% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.07.2013г. са 20.78% от стойността на портфейла.

Вземанията от лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, начислени дивиденди, хеджиране и платени такси към БФБ и КФН възлизат на 6.83% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.07.2013 г. е минус 1.64% на годишна база\*. Доходността от началото на годината е 12.60% , а доходността за последните 12 месеца към 31.07.2013г. е 11.93%.

**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 31.07.2013г. е представена в следната таблица и графика.

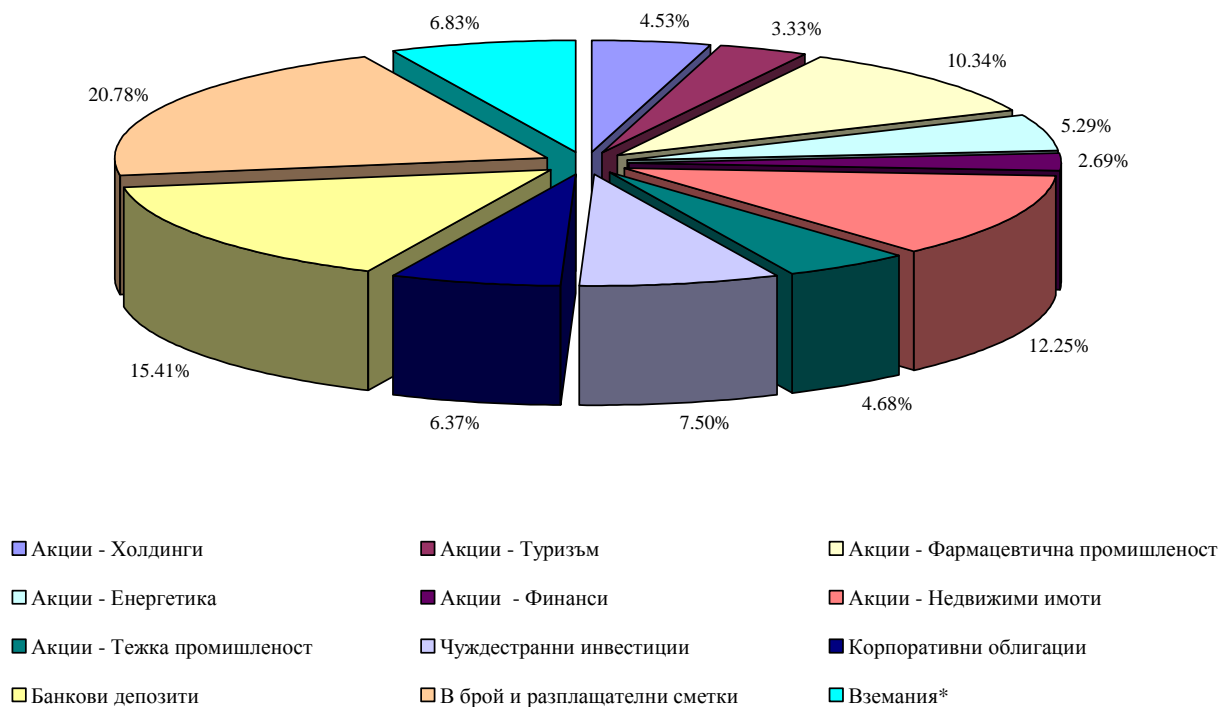
---

\* 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 31.07.2013 г.**

Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	92 904	4.53%
Акции - Туризм	68 224	3.33%
Акции - Фармацевтична промишленост	212 143	10.34%
Акции - Енергетика	108 454	5.29%
Акции - Финанси	55 283	2.69%
Акции - Недвижими имоти	251 462	12.25%
Акции - Тежка промишленост	95 929	4.68%
Чуждестранни инвестиции	153 800	7.50%
Корпоративни облигации	130 834	6.37%
Банкови депозити	316 005	15.41%
В брой и разплащателни сметки	426 172	20.78%
Вземания*	140 009	6.83%
Общо активи	2 051 219	100.00%

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

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/07/2013**


**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.

<b>Рисков актив</b>				
<b>ISIN</b>	<b>Валута</b>	<b>Брой</b>	<b>Цена</b>	<b>Обща Стойност</b>
Валутно деноминиран актив	USD	59 214.240	1.0000	\$59 214.24
Валутно деноминиран актив	USD	329.000	168.710	\$55 505.59
Валутно деноминиран актив	USD	705.000	69.340	\$48 884.70
<b>Обща рискова позиция</b>				<b>\$163 604.53</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>
Форурд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 123 000.00	1.30517	\$160 535.91	OTC	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>				<b>\$160 535.91</b>		

Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД