

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 30.09.2013г. 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 30.09.2013г. възлиза на 44.99%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 12.27% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 30.09.2013г. корпоративните облигации представляват 6.33% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Банковите депозити съставляват 15.59% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.09.2013г. са 14.90% от стойността на портфейла.

Вземанията от лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, хеджиране, начислени дивиденди и платени такси към БФБ и КФН възлизат на 5.92% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.09.2013 г. е минус 1.49% на годишна база*. Доходността от началото на годината е 13.66% , а доходността за последните 12 месеца към 30.09.2013г. е 13.12%.

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

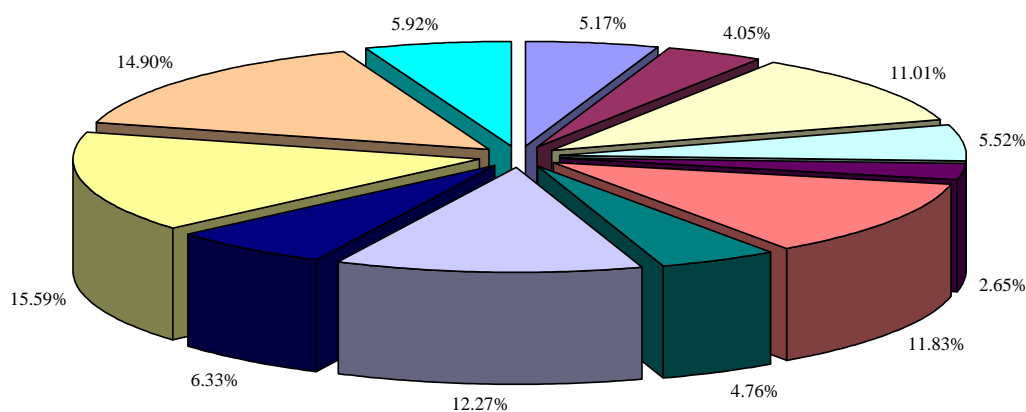
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 30.09.2013г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 30.09.2013 г.

Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	106 056	5.17%
Акции - Туризм	82 954	4.05%
Акции - Фармацевтична промишленост	225 631	11.01%
Акции - Енергетика	113 266	5.52%
Акции - Финанси	54 367	2.65%
Акции - Недвижими имоти	242 628	11.83%
Акции - Тежка промишленост	97 505	4.76%
Чуждестранни инвестиции	251 669	12.27%
Корпоративни облигации	129 824	6.33%
Банкови депозити	319 619	15.59%
В брой и разплащателни сметки	305 358	14.90%
Вземания*	121 440	5.92%
Общо активи	2 050 317	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 30/09/2013


- Акции - Холдинги
- Акции - Туризм
- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Енергетика
- Акции - Финанси
- 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	59 511.290	1.0000	\$59 511.29
Валутно деноминиран актив	USD	329.000	168.010	\$55 275.29
Валутно деноминиран актив	USD	705.000	66.140	\$46 628.70
Обща рискова позиция				\$161 415.28

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 123 000.00	1.330280	\$163 624.44	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$163 624.44		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД