

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 31.10.2014г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик са разпределени в 5 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 31.10.2014г. възлиза на 29.21%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 30.01% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.10.2014г. корпоративните облигации представляват 4.85% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.10.2014г. са 12.62% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии, по договор, начислени дивиденди и платена такса към КФН възлизат на 23.31% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.10.2014 г. е минус 1.17% на годишна база*. Доходността от началото на годината е 0.17%, а доходността за последните 12 месеца към 31.10.2014г. е 1.49%.

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

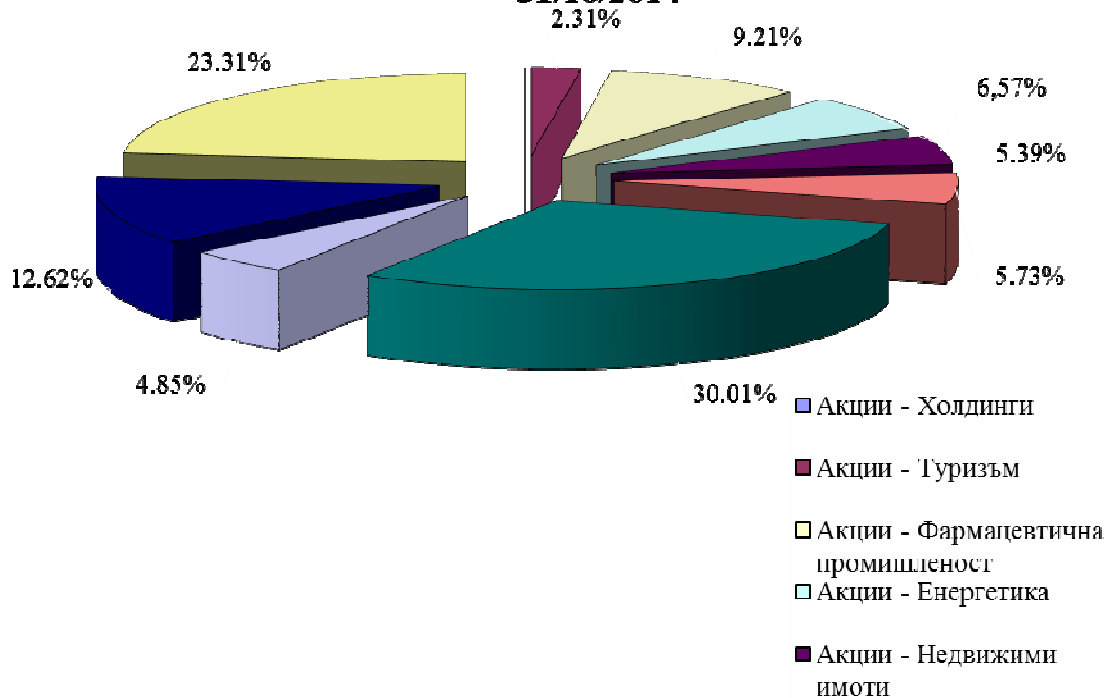
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31.10.2014г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 31.10.2014 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Туризм	41 414	2.31%
Акции - Фармацевтична промишленост	165 450	9.21%
Акции - Енергетика	118 075	6.57%
Акции - Недвижими имоти	96 915	5.39%
Акции - Тежка промишленост	102 904	5.73%
Чуждестранни инвестиции	539 158	30.01%
Корпоративни облигации	87 201	4.85%
В брой и разплащателни сметки	226 635	12.62%
Вземания*	418 761	23.31%
Общо активи	1 796 512	100.00%

* Вземания във връзка с начислени дивиденди, главнца и лихви по облигационни емисии, платена такса към КФН, вземания по договор.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/10/2014



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.

Рисков актив				
ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
Валутно деноминиран актив	USD	1 982.640	1.0000	\$1 982.64
Валутно деноминиран актив	USD	449.000	201.660	\$90 545.34
Валутно деноминиран актив	USD	570.000	101.400	\$57 798.00
Обща рискова позиция				\$150 325.98

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форурд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 113 500.00	1.266400	\$143 736.40	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$143 736.40		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД