

**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 31.12.2013г. 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 31.12.2013г. възлиза на 41.20%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 29.18% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.12.2013г. корпоративните облигации представляват 6.71% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Банковите депозити съставляват 16.94% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.12.2013г. са 1.29% от стойността на портфейла.

Вземанията от лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации и начислени дивиденди възлизат на 4.68% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.12.2013 г. е минус 1.03% на годишна база\*. Доходността от началото на годината и доходността за последните 12 месеца към 30.12.2013г. е 15.05%.

**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 31.12.2013г. е представена в следната таблица и графика.

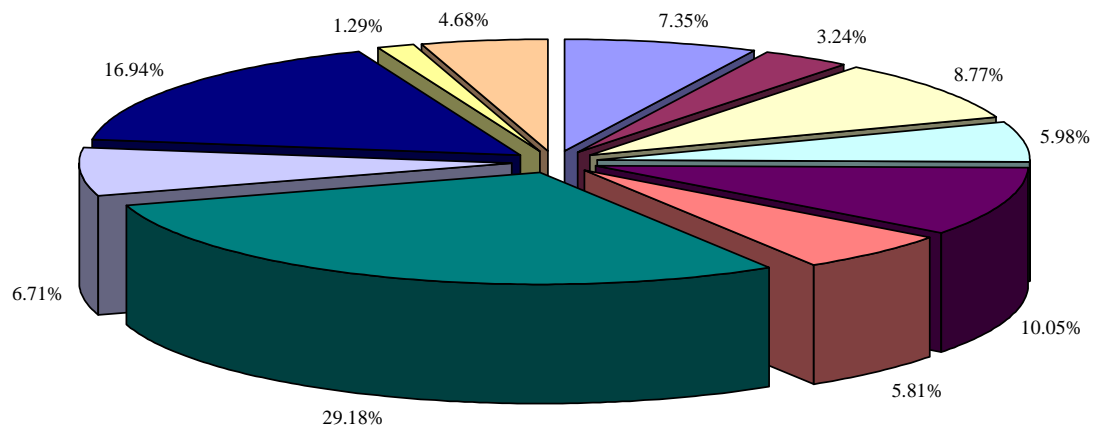
---

\* 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 31.12.2013 г.**

Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	140 973	7.35%
Акции - Туризм	62 178	3.24%
Акции - Фармацевтична промишленост	168 223	8.77%
Акции - Енергетика	114 794	5.98%
Акции - Недвижими имоти	192 969	10.05%
Акции - Тежка промишленост	111 551	5.81%
Чуждестранни инвестиции	559 997	29.18%
Корпоративни облигации	128 851	6.71%
Банкови депозити	325 040	16.94%
В брой и разплащателни сметки	24 821	1.29%
Вземания*	89 871	4.68%
Общо активи	1 919 268	100.00%

\* Вземания във връзка с начислени дивиденди, лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации.

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/12/2013**


- |                               |                         |                                    |
|-------------------------------|-------------------------|------------------------------------|
| 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	332.270	1.0000	\$332.27
Валутно деноминиран актив	USD	570.000	87.390	\$49 812.30
Валутно деноминиран актив	USD	449.000	183.820	\$82 535.18
<b>Обща рискова позиция</b>				\$132 679.75

<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	€ 96 000.00	1.378824	\$132 367.10	ОТС	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>				\$132 367.10		

Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД