

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. Продадени са и чуждестранни инвестиции.

Към 31.03.2015г. 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 31.03.2015г. възлиза на 28.03%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 36.55% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.03.2015г. корпоративните облигации представляват 4.83% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.03.2015г. са 15.16% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии , вземане по договор, начислени дивиденди, хеджиране и платена такса КФН възлизат на 15.43% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.03.2015г. е минус 0.88% на годишна база*. Доходността от началото на годината е 2.37%, а доходността за последните 12 месеца към 31.03.2015г. е минус 1.44%.

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

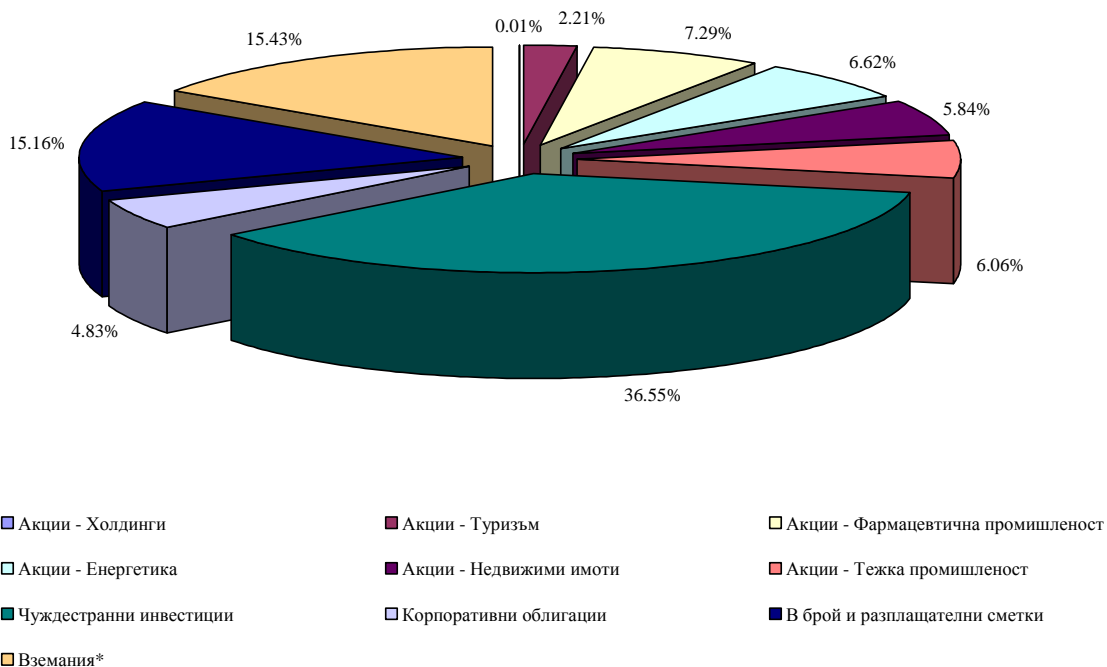
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31.03.2015г. е представена в следната таблица и графика.

* 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 31.03.2015 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	242	0.01%
Акции - Туризм	38 463	2.21%
Акции - Фармацевтична промишленост	126 682	7.29%
Акции - Енергетика	114 897	6.62%
Акции - Недвижими имоти	101 533	5.84%
Акции - Тежка промишленост	105 269	6.06%
Чуждестранни инвестиции	635 078	36.55%
Корпоративни облигации	83 979	4.83%
В брой и разплащателни сметки	263 390	15.16%
Вземания*	268 014	15.43%
Общо активи	1 737 547	100.00%

* Вземания във връзка с начислени дивиденди, главница и лихва по облигационни емисии, платени такси към КФН, вземания от хеджиране и вземания по договор.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/03/2015



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	12 750.980	1.0000	\$12 750.98
Валутно деноминиран актив	USD	400.000	206.430	\$82 572.00
Валутно деноминиран актив	USD	570.000	105.600	\$60 192.00
Обща рискова позиция				\$155 514.98

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 144 000.00	1.062510	\$153 001.44	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$153 001.44		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД