

**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 31.03.2014г. 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 31.03.2014г. възлиза на 39.12%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 29.02% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.03.2014г. корпоративните облигации представляват 8.20% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Банковите депозити съставляват 16.87% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.03.2014г. са 2.16% от стойността на портфейла.

Вземанията от лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации и начислени дивиденди, както и платени такси към КФН възлизат на 4.63% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.03.2014 г. е минус 0.81% на годишна база\*. Доходността от началото на годината е 3.99%, а доходността за последните 12 месеца към 31.03.2014г. е 13.87%.

**I. Данни по чл. 72, ал. 2 от Наредба № 44**

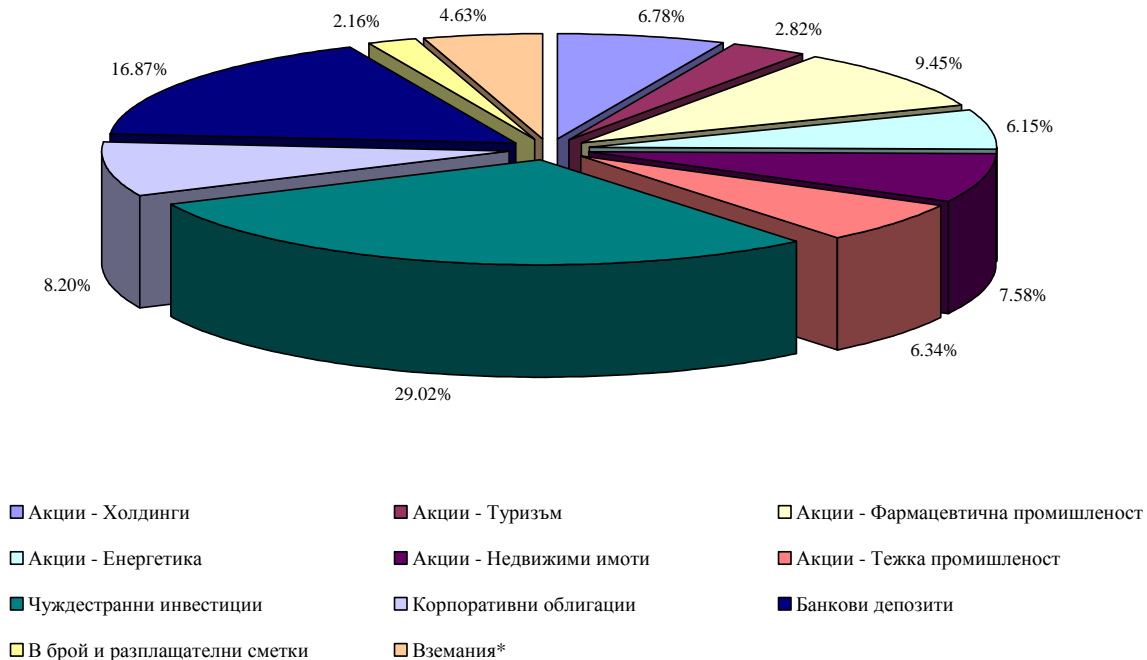
**1) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти**

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31.03.2014г. е представена в следната таблица и графика.

\* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

<b>Структура на портфейла на ДФ "Ти Би Ай Динамик" към 31.03.2014 г.</b>		
<b>Актив</b>	<b>Стойност в лева</b>	<b>Процент от активите</b>
Акции - Холдинги	132 787	6.78%
Акции - Туризм	55 250	2.82%
Акции - Фармацевтична промишленост	185 092	9.45%
Акции - Енергетика	120 460	6.15%
Акции - Недвижими имоти	148 309	7.58%
Акции - Тежка промишленост	124 211	6.34%
Чуждестранни инвестиции	568 384	29.02%
Корпоративни облигации	160 512	8.20%
Банкови депозити	330 462	16.87%
В брой и разплащателни сметки	42 394	2.16%
Вземания*	90 688	4.63%
<b>Общо активи</b>	<b>1 958 549</b>	<b>100.00%</b>

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

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/03/2014**


**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.

<b>Рисков актив</b>				
<b>ISIN</b>	<b>Валута</b>	<b>Брой</b>	<b>Цена</b>	<b>Обща Стойност</b>
Валутно деноминиран актив	USD	885.650	1.0000	\$885.65
Валутно деноминиран актив	USD	570.000	87.670	\$49 971.90
Валутно деноминиран актив	USD	449.000	187.010	\$83 967.49
<b>Обща рискова позиция</b>				<b>\$134 825.04</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	€ 98 000.00	1.391330	\$136 350.34	ОТС	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>				<b>\$136 350.34</b>		

Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД