

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 31.05.2014г. 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 31.05.2014г. възлиза на 37.90%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 30.30% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 31.05.2014г. корпоративните облигации представляват 4.59% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Банковите депозити съставляват 17.04% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.05.2014г. са 2.00% 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 8.17% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.05.2014 г. е минус 0.55% на годишна база*. Доходността от началото на годината е 6.24%, а доходността за последните 12 месеца към 31.05.2014г. е 11.37%.

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

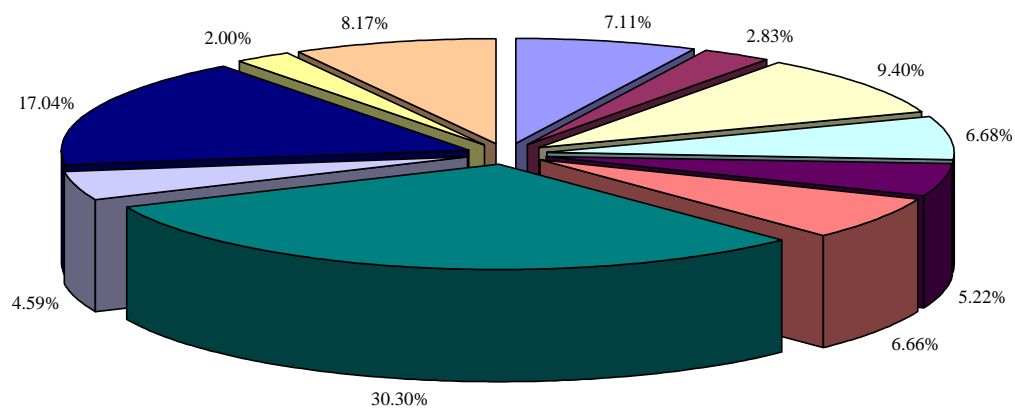
1) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 31.05.2014г. 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 31.05.2014 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	139 321	7.11%
Акции - Туризм	55 534	2.83%
Акции - Фармацевтична промишленост	184 063	9.40%
Акции - Енергетика	130 907	6.68%
Акции - Недвижими имоти	102 187	5.22%
Акции - Тежка промишленост	130 531	6.66%
Чуждестранни инвестиции	593 558	30.30%
Корпоративни облигации	89 968	4.59%
Банкови депозити	333 763	17.04%
В брой и разплащателни сметки	39 174	2.00%
Вземания*	160 072	8.17%
Общо активи	1 959 078	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 31/05/2014


- | | | |
|-------------------------------|-------------------------|------------------------------------|
| 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.

Рисков актив				
ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
Валутно деноминиран актив	USD	1 218.710	1.0000	\$1 218.71
Валутно деноминиран актив	USD	449.000	192.680	\$86 513.32
Валутно деноминиран актив	USD	570.000	91.310	\$52 046.70
Обща рискова позиция				\$139 778.73

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 98 000.00	1.366140	\$133 881.72	ОТС	България
Обща хеджираща позиция				\$133 881.72		

Красимир Петков
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД