

**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 30.04.2015г. 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 30.04.2015г. възлиза на 28.58%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 37.07% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 30.04.2015г. корпоративните облигации представляват 4.95% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.04.2015г. са 15.46% от стойността на портфейла.

Вземанията за главница и лихва по облигационни емисии , вземане по договор, начислени дивиденди, хеджиране и платена такса КФН възлизат на 13.94% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.04.2015г. е минус 1.23% на годишна база\*. Доходността от началото на годината е минус 1.12%, а доходността за последните 12 месеца към 30.04.2015г. е минус 5.97%.

**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**

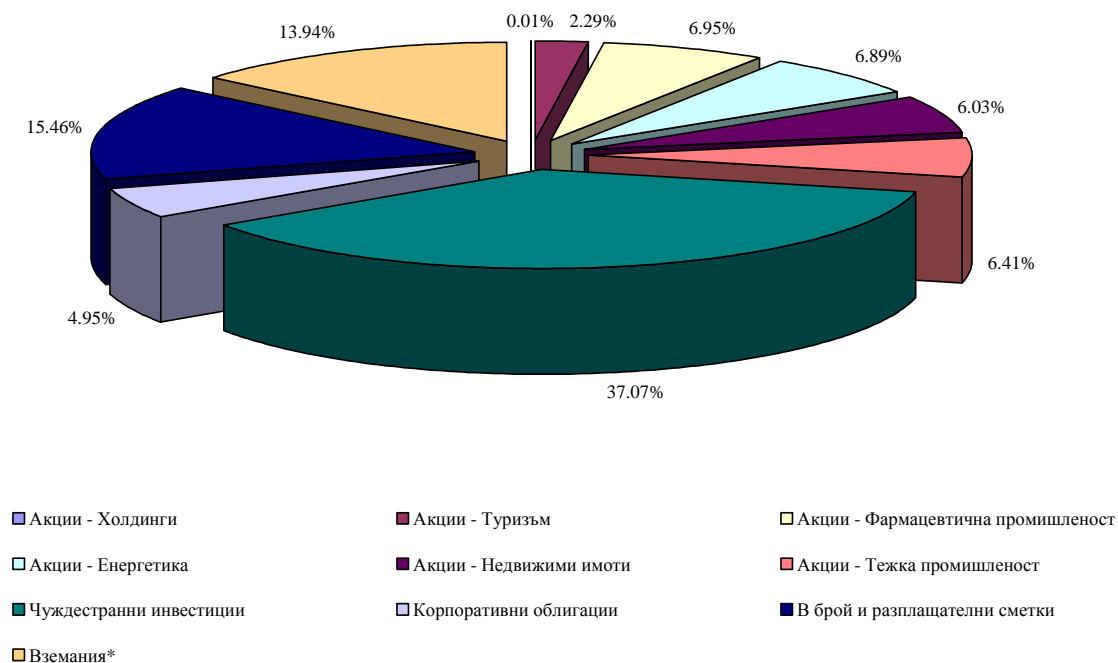
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 30.04.2015г. е представена в следната таблица и графика.

\* 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 30.04.2015 г.		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	244	0.01%
Акции - Туризм	38 376	2.29%
Акции - Фармацевтична промишленост	116 476	6.95%
Акции - Енергетика	115 583	6.89%
Акции - Недвижими имоти	100 992	6.03%
Акции - Тежка промишленост	107 538	6.41%
Чуждестранни инвестиции	621 505	37.07%
Корпоративни облигации	82 855	4.95%
В брой и разплащателни сметки	259 174	15.46%
Вземания*	233 792	13.94%
Общо активи	1 676 535	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 30/04/2015



**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.

<b>Рисков актив</b>				
<b>ISIN</b>	<b>Валута</b>	<b>Брой</b>	<b>Цена</b>	<b>Обща Стойност</b>
Валутно деноминиран актив	USD	13 139.270	1.0000	\$13 139.27
Валутно деноминиран актив	USD	400.000	208.460	\$83 384.00
Валутно деноминиран актив	USD	570.000	107.630	\$61 349.10
<b>Обща рискова позиция</b>				<b>\$157 872.37</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>
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 144 000.00	1.064480	\$153 285.12	OTC	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>				<b>\$153 285.12</b>		

Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД