

**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 30.06.2014г. 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 30.06.2014г. възлиза на 36.05%.

Делът на чуждестранните инвестиции е 27.55% от активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Към 30.06.2014г. корпоративните облигации представляват 4.73% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Динамик.

Банковите депозити съставляват 17.59% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.06.2014г. са 5.31% от стойността на портфейла.

Вземанията от лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, хеджиране и начислени дивиденди, както и платени такси към КФН възлизат на 8.77% от активите на Фонда

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.06.2014 г. е минус 0.79% на годишна база\*. Доходността от началото на годината е 3.96%, а доходността за последните 12 месеца към 30.06.2014г. е 7.47%.

**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**

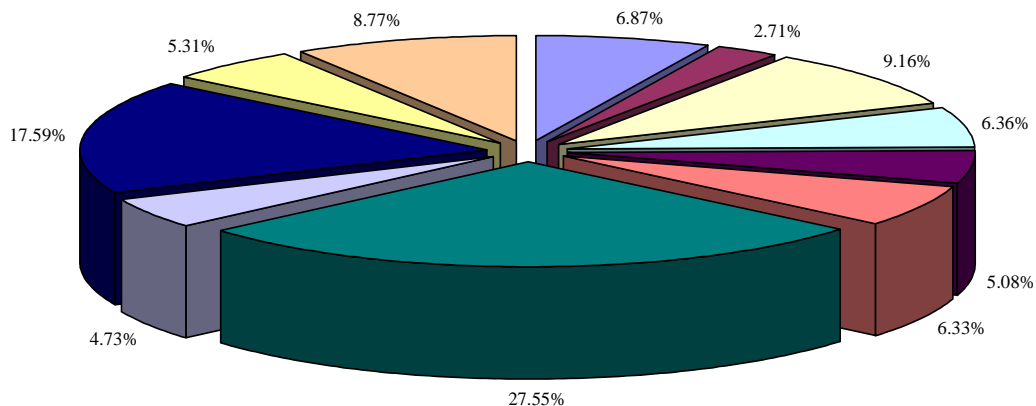
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Динамик към 30.06.2014г. е представена в следната таблица и графика.

\* 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 30.06.2014 г.**

Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	131 057	6.87%
Акции - Туризм	51 604	2.71%
Акции - Фармацевтична промишленост	174 645	9.16%
Акции - Енергетика	112 503	5.90%
Акции - Недвижими имоти	96 832	5.08%
Акции - Тежка промишленост	120 664	6.33%
Чуждестранни инвестиции	525 358	27.55%
Корпоративни облигации	90 276	4.73%
Банкови депозити	335 351	17.59%
В брой и разплащателни сметки	101 319	5.31%
Вземания*	167 348	8.77%
Общо активи	1 907 020	100.00%

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

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Динамик към 30/06/2014**


- 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.

<b>Рисков актив</b>				
<b>ISIN</b>	<b>Валута</b>	<b>Брой</b>	<b>Цена</b>	<b>Обща Стойност</b>
Валутно деноминиран актив	USD	1 214.63	1.0000	\$1 214.63
Валутно деноминиран актив	USD	449	195.72	\$87 878.28
Валутно деноминиран актив	USD	570	93.91	\$53 528.70
<b>Обща рискова позиция</b>				<b>\$142 621.61</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	104000	1.356384	\$141 063.94	OTC	България
<b>Обща хеджираща позиция</b>				<b>\$141 063.94</b>		

Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД