

Асет Менѝжмънт

ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО

ЧЛ. 48 и ЧЛ. 73г ОТ НАРЕДБА № 25 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА ИНВЕСТИЦИОННИТЕ ДРУЖЕСТВА И ДОГОВОРНИ ФОНДОВЕ ЗА ДОГОВОРЕН ФОНД „ТИ БИ АЙ СЪКРОВИЩЕ”

1. Данни по чл. 73г, ал. 1, т. 6 от Наредба № 25

1) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б „г”: Промени в структурата на портфейла през отчетния период

Съгласно балансираната инвестиционна политика и стратегия на Фонда за инвестиране на до 60% от активите в дългови ценни книжа и до 60% в акции, както и до 20% от активите в дялове на колективни инвестиционни схеми, през периода са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и са закупени и продадени акции на публични дружества на БФБ – София АД.

Съгласно балансираната инвестиционна политика и стратегия на Ти Би Ай Съкровище, през периода от началото на публичното предлагане до 31.03.2011 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 31.03.2011 г. корпоративните облигации представляват 37.81% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище, а ипотечните облигации представляват 6.94% от общите активи на Фонда.

Към 31.03.2011 г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 43.76% от общите активи на фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 9.78% от портфейла на Ти Би Ай Съкровище.

Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 1.57% от активите на Фонда към 31.03.2011 г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.03.2011 г. е 2.66%¹, доходността за последните 12 месеца към 31.03.2011г. е 6.88%, а доходността от началото на годината е 5.08%.

2) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „а” и „д”: Промени в състоянието на активите в рамките на отчетния период

Долната таблица представя приходите на Фонда към 31.03.2011 г. Приходите са в размер на 28 729.46 лева, включващи приходи от положителни разлики от операции с финансови активи, приходи от лихви, приходи от положителни валутни курсови разлики и други приходи.

¹ Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.



Асет Мениджмънт

Приходи	Стойност в лева	Стойност в лева	Стойност в лева
	30/09/2010	30/12/2010	31/03/2011
Приходи от лихви	26 845	32 967	1 603
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	267 270	346 102	25 973
Положителни курсови разлики	72 057	104 378	1 152
Други финансови приходи	3 198	3 977	2
Общо приходи:	369 369	487 425	28 729

Разходите на Фонда за отчетния период са представени в таблицата по-долу:

Разходи	Стойност в лева	Стойност в лева	Стойност в лева
	30/09/2010	30/12/2010	31/03/2011
Разходи от операции с финансови активи	254 867	339 133	19 336
Отрицателни курсови разлики	69 682	103 020	1 235
Разходи за външни услуги	14 399	18 244	1 792
Други финансови разходи	1 570	2 768	342
Общо разходи:	340 518	463 165	22 705

Общият размер на разходите на фонда към 31.03.2011 г. е 22 705.03 лева, които включват 19 335.96 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 1 235.24 лв. разходи от отрицателни курсови разлики.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 31 март 2011 – 558.21 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.45%

б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество

- към 31 март 2011 – 106.61 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.09%

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 31 март 2011 – 900.36 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.73%

г) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие

- към 31 март 2011 – 105 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.09%

д) Други разходи

- към 31 март 2011 – 463.65 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.38%



Асет Мениджмънт

- Други разходи по финансови операции: 235.65 лв.
- Външни услуги (КФН, ЦД и БФБ): 228 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 2 133.83 лв. към месец март. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 1.73%.

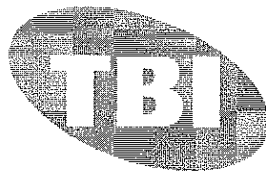
За периода са записани 40.9071 дяла и са изкупени обратно 10 300.1380 дяла. НСА на фонда към 31.03.2011 г. е 114 915.01 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 5 243.7935.

3) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „в“: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище в края на периода е представена в следната таблица и графика.

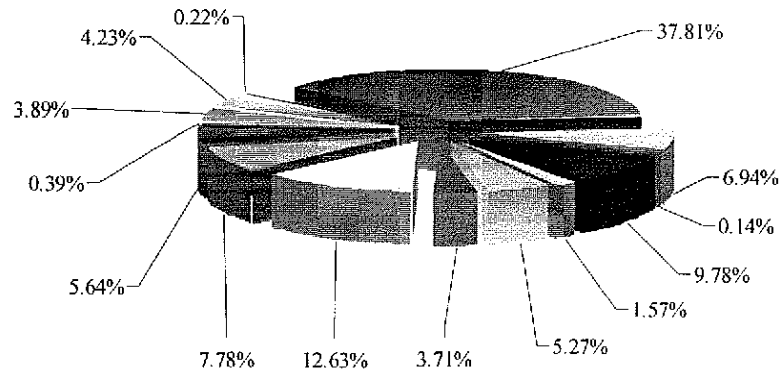
Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище към 31.03.2011		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
Акции Туризм	6 108	5.27%
Акции Електроника	4 303	3.71%
Акции Недвижими имоти	14 645	12.63%
Акции Холдинги	9 018	7.78%
Акции Енергетика	6 533	5.64%
Акции Услуги	453	0.39%
Акции Тежка промишленост	4 510	3.89%
Акции Фармацевтична промишленост	4 900	4.23%
Акции Финансови институции	251	0.22%
Корпоративни облигации	43 832	37.81%
Ипотечни облигации	8 047	6.94%
Вземания	165	0.14%
Банкови депозити	11 332	9.78%
В брой и разплащателни сметки	1 820	1.57%
Общо активи	115 918	100.00%

* Вземания във връзка с предварително платени такси за БФБ и КФН



Асет Мениджмънт

Разпределение на активите на Ти Би Ай Съкровище към 31.03.2011 г.



- Акции Туризм
- Акции Недвижими имоти
- Акции Енергетика
- Акции Тежка промишленост
- Акции Финансови институции
- Ипотечни облигации
- Банкови депозити
- Акции Електроника
- Акции Холдинги
- Акции Услуги
- Акции Фармацевтична промишленост
- Корпоративни облигации
- Вземания
- В брой и разплащателни сметки

4) Дани по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „б“: Нетна стойност на активите на един дял

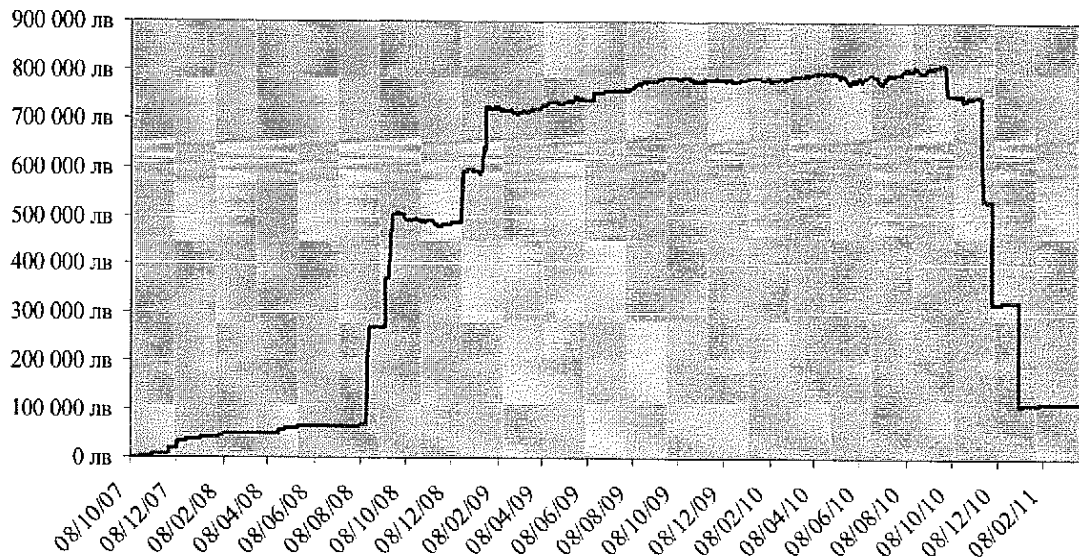
Към 31.03.2011 г. нетната стойност на активите на един дял е 21.9145.

Изменението на нетната стойност на активите на Фонда е представено на следващата графика.



Асет Мениджмънт

Нетна стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище



II. Данни по чл. 48, ал. 3, т. 2 от от Наредба № 25

Към 31.03.2011 г. Фондът не притежава валутно деноминирани активи и не е изложен на валутен риск, в следствие на което управляващото дружество не извършва хеджиращи сделки с цел предпазване от валутен риск.

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Мирослав Маринков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

