

# Асет Мениджмънт

## 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”

### I. 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 30.09.2011 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 30.09.2011 г. корпоративните облигации представляват 36.97% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище, а ипотечните облигации представляват 9.22% от общите активи на Фонда.

Към 30.09.2011 г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 37.05% от общите активи на фонда.

Делът на ишвестициите в депозити е 10.80% от портфейла на Ти Би Ай Съкровище.

Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 5.76% от активите на Фонда към 30.09.2011 г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.09.2011 г. с 1.19%<sup>1</sup>, доходността за последните 12 месеца към 30.09.2011г. с -0.30%, а доходността от началото на годината е 0.52%.

#### 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 30.09.2011 г. Приходите са в размер на 64 862.54 лева, включващи приходи от положителни разлики от операции с финансови активи, приходи от лихви, приходи от положителни валутни курсови разлики и други приходи.

<sup>1</sup> Доходността е изчислена въз основа на петната стойност на активите на един дял на съответните дати.



# Асет Мениджмънт

Приходи	Стойност в лева	Стойност в лева	Стойност в лева
	31.3.2011	30.6.2011	30.9.2011
Приходи от лихви	1 603	2 800	3 992
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	25 973	40 726	58 272
Положителни курсови разлики	1 152	1 181	1 218
Други финансови приходи	2	318	1381
<b>Общо приходи:</b>	<b>28 729</b>	<b>45 025</b>	<b>64 863</b>

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

Разходи	Стойност в лева	Стойност в лева	Стойност в лева
	31.3.2011	30.6.2011	30.9.2011
Разходи от операции с финансови активи	19 336	36 834	58 666
Отрицателни курсови разлики	1 235	1 275	1 300
Разходи за външни услуги	1 792	2 794	3 321
Други финансови разходи	342	450	515
<b>Общо разходи:</b>	<b>22 705</b>	<b>41 353</b>	<b>63 803</b>

Общият размер на разходите на фонда към 30.09.2011 г. е 63 802.90 лева, които включват 58 666.23 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 1 300.46 лв. разходи от отрицателни курсови разлики.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество  
- към 30 септември 2011 – 1 566.94 лв.  
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.27%

- б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество  
- към 30 септември 2011 – 115.74 лв.  
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.09%

- в) Възнаграждение на банката депозитар  
- към 30 септември 2011 – 1 200.36 лв.  
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.97%

- г) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие  
- към 30 септември 2011 – 140 лв.  
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.11%

- д) Други разходи  
- към 30 септември 2011 – 813.17 лв.



# Асет Мениджмънт

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.66%

- Други разходи по финансови операции: 399.63 лв.

- Външни услуги (КФН, ИД и БФБ): 413.54 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 3 836.21 лв. към месец септември. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 3.11%.

За периода са записани 53.5289 дяла и са изкупени обратно 130.6571 дяла. НСА на фонда към 30.09.2011 г. е 108 311.09 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 5 166.6653.

### 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.

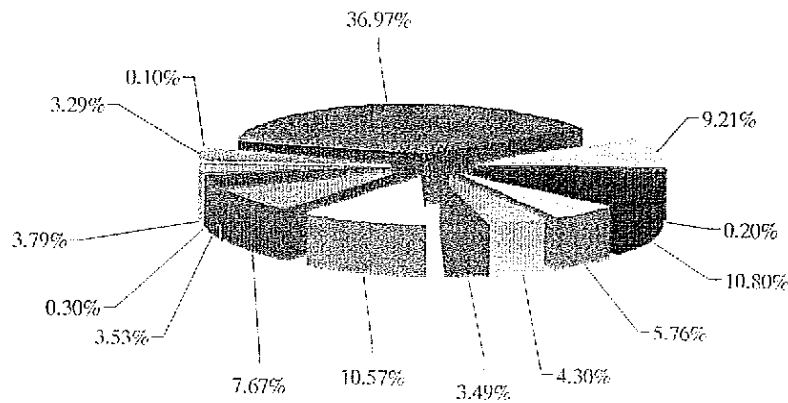
Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище към 30.09.2011		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
Акции Туризм	4 676	4.30%
Акции Електроника	3 790	3.49%
Акции Недвижими имоти	11 489	10.57%
Акции Холдинги	8 333	7.67%
Акции Енергетика	3 836	3.53%
Акции Услуги	325	0.30%
Акции Тежка промишленост	4 116	3.79%
Акции Фармацевтична промишленост	3 579	3.29%
Акции Финансови институции	111	0.10%
Корпоративни облигации	40 175	36.97%
Ипотечни облигации	10 011	9.21%
Вземания	217	0.20%
Банкови депозити	11 739	10.80%
В брой и разплащателни сметки	6 258	5.76%
Общо активи	108 657	100.00%

\* Вземания във връзка с предварително платени такси за БФБ, плащане на дивидент и продажби на права.



# Асет Мениджмънт

## Разпределение на активите на Ти Би Ай Съкровище към 30.09.2011 г.



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

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

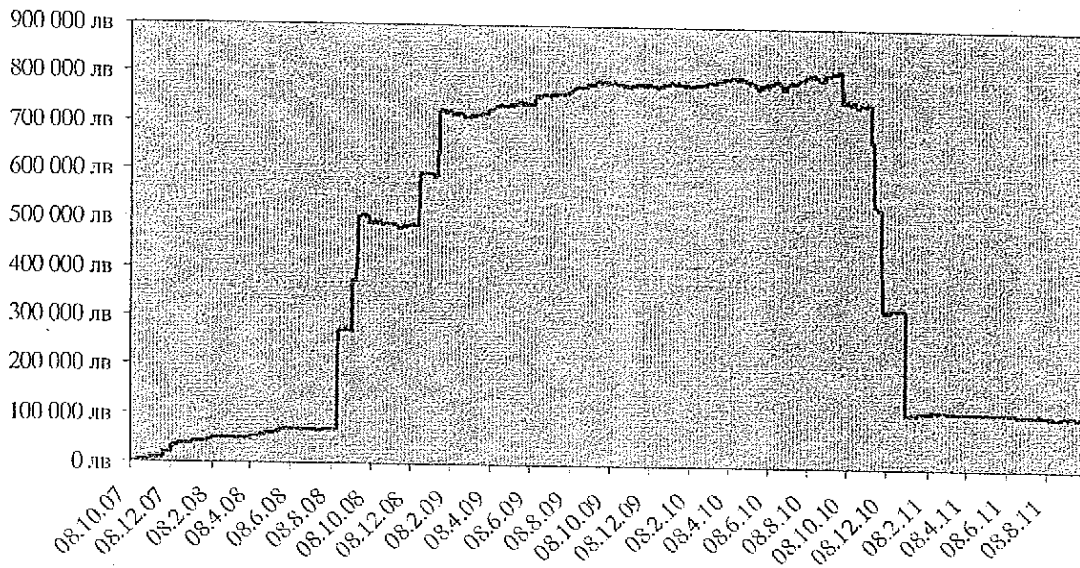
Към 30.09.2011 г. нетната стойност на активите на един дял е 20,9634.

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 30.09.2011 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.

Мирослав Маринов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

