

# Асет Мениджмънт

## ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО

**ЧЛ. 73(1) т.5 ОТ НАРЕДБА № 44 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА КОЛЕКТИВНИТЕ ИНВЕСТИЦИОННИ СХЕМИ, ИНВЕСТИЦИОННИТЕ ДРУЖЕСТВА ОТ ЗАТВОРЕН ТИП И УПРАВЛЯВАЩИТЕ ДРУЖЕСТВА**

### **ДОГОВОРЕН ФОНД „ТИ БИ АЙ СЪКРОВИЩЕ”**

#### **I. Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5 от Наредба № 44**

##### **1) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5, 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 от началото на публичното предлагане до 31.12.2014 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 31.12.2014 г. корпоративните облигации представляват 18.81% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище, като в активите на Фонда няма общински облигации и ипотечни облигации към 31.12.2014 г.

Към 31.12.2014 г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 39.38% от общите активи на Фонда.

Към 31.12.2014 г. фондът няма инвестиции в депозити.

Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 21.53% от активите на Фонда към 31.12.2014 г.

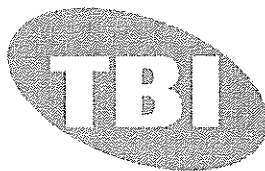
Вземанията от начислено лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, както и вземане по договор възлизат на 20.28% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.12.2014 г. е 2.82% на годишна база\*, а доходността за последните 12 месеца към 31.12.2014 г. е 0.44%.

##### **2) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5, б. „а” и „д”: Промени в състоянието на активите в рамките на отчетния период**

Долната таблица представя приходите на Фонда към 31.12.2014 г. Приходите са в размер на 63 205 лева, включващи приходи от операции с финансови активи, приходи от положителни курсови разлики, приходи от лихви и други финансови приходи.

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



# Асет Мениджмънт

НАИМЕНОВАНИЕ НА ПРИХОДИТЕ	Стойност в лева	
	30.06.2014	31.12.2014
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	28	75
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	33 802	58 034
Приходи от лихви	1 423	2 266
Други финансови приходи	2 327	2 830
<b>ОБЩО ПРИХОДИ</b>	<b>37 580</b>	<b>63 205</b>

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

НАИМЕНОВАНИЕ НА РАЗХОДИТЕ	Стойност в лева	
	30.06.2014	31.12.2014
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	26	52
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	32 149	56 309
Други разходи	35	4 266
Разходи за външни услуги	1 027	2 046
<b>ОБЩО РАЗХОДИ</b>	<b>33 237</b>	<b>62 673</b>

Общият размер на разходите на Фонда към 31.12.2014 г. е 62 673 лева, които включват 56 309 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти, 52 лева разходи от отрицателни курсови разлики, както и 6 312 лева разходи, представени подробно по-долу.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 31 декември 2014 – 2 046 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.80%

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

- към 31 декември 2014 – 28 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.02%

в) Други разходи

- към 31 декември 2014 – 4 238 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 3.74%

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – в) – 6 312 лв. за 2014 г. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 5.56%.

	Стойност в лева	
	30.06.2014	31.12.2014
Общо приходи	37 580	63 205
Общо разходи	33 237	62 673
<b>Нетен Резултат</b>	<b>4 343</b>	<b>532</b>



# Асет Мениджмънт

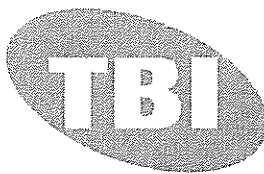
За периода са записани 38.0277 дяла и са изкупени обратно 76.7348 броя дялове. НСА на Фонда към 31.12.2013 г. е 108 851 лв., а към 31.12.2014 г. е 108 385 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 4 430.6709.

### 3) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5, б. „в” и „г”: 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:

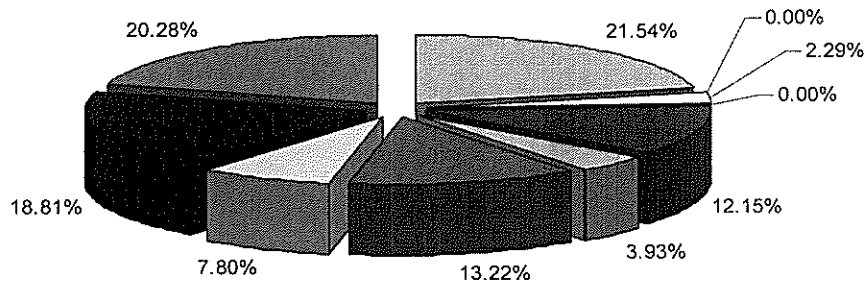
Актив	Стойност в лева 31.12.2013	Процент от активите 31.12.2013	Стойност в лева 31.12.2014	Процент от активите 31.12.2014	Валута (EUR, USD, BGN)
В брой и разплащателни сметки	6 956	6.38%	23 379	21.53%	EUR, USD, BGN
Банкови депозити	20 192	18.52%	0.00	0.00%	EUR
Акции - Туризъм	3 214	2.95%	2 482	2.29%	BGN
Акции - Холдинги	2 579	2.37%	0.00	0.00%	BGN
Акции - Недвижими имоти	15 408	14.13%	13 188	12.15%	BGN
Акции - Енергетика	4 718	4.33%	4 262	3.92%	BGN
Акции – Фармацевтична промишленост	15 004	13.77%	14 348	13.22%	BGN
Акции – Тежка промишленост	8 512	7.81%	8 468	7.80%	BGN
Корпоративни облигации	28 879	26.48%	20 424	18.81%	EUR
Вземания *	3 555	3.26%	22 011	20.28%	BGN
Общо активи	109 017	100.00%	108 562	100.00%	

\* Вземания във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, вземане по договор



# Асет Мениджмънт

Разпределение на активите на Ти Би Ай Съкровище към 31/12/14



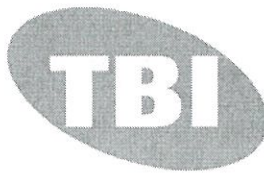
- |   |   |   |
|---|---|---|
| <input type="checkbox"/> В брой и разплащателни сметки      | <input type="checkbox"/> Банкови депозити           | <input type="checkbox"/> Акции - Туризъм        |
| <input type="checkbox"/> Акции - Холдинги                   | <input type="checkbox"/> Акции - Недвижими имоти    | <input type="checkbox"/> Акции - Енергетика     |
| <input type="checkbox"/> Акции - Фармацевтична промишленост | <input type="checkbox"/> Акции - Тежка промишленост | <input type="checkbox"/> Корпоративни облигации |
| <input type="checkbox"/> Вземания *                         |   |   |

#### 4) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5, б. „б“: Нетна стойност на активите на един дял

Към 31.12.2013 г. нетната стойност на активите на един дял е в размер на 24.3549. На 30.06.2014 г. изчислената нетна стойност на активите на един дял е в размер на 25.3241. Към 31.12.2014 г. нетната стойност на активите на един дял е 24.4624 лв.

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





# Асет Мениджмънт

- 5) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 6, б. „е“: Сравнителна таблица за последните три финансови години, включваща общата стойност на нетните активи и нетна стойност на един дял

	Към 31 декември 2012 в лева	Към 31 декември 2013 в лева	Към 31 декември 2014 в лева
Нетна стойност на активите	102 133	108 851	108 385
Нетна стойност на активите на един дял	21.3118	24.3549	24.4624

- 6) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5, б. „ж“: Задължения, възникнали от сделки с деривативни инструменти

Към 31.12.2014 г. Фондът не притежава активи, деноминирани във валута, различна от лева и евро, и поради тази причина няма сключени хеджиращи сделки.

Красимир Петков  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

