

**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 30.12.2009 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 30.12.2009 г. корпоративните облигации представляват 48.70% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище. Ипотечните облигации представляват 4.26% от общите активи на Фонда, а общинските облигации – 3.63% от активите на Фонда.

Към 30.12.2009 г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 14.70% от общите активи на фонда. Чуждестранните инвестиции са 7.65% от активите на Фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 15.51% от портфейла на Ти Би Ай Съкровище.

Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 5.53% от активите на Фонда към 30.12.2009 г.

Реализираната доходност от началото на годината до 30.12.2009 г. е 7.18%<sup>1</sup>.

**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 30.12.2009 г. Приходите са в размер на 321 590 лева, включващи преоценка от операции с финансови активи и приходи от лихви.

Приходи	Стойност в лева	Стойност в лева	Стойност в лева
	30/06/2009	30/09/2009	30/12/2009
Приходи от лихви	19 492	30 639	40 917
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	159 338	220 263	273 609
Положителни курсови разлики	0	0	3 805
Други финансови приходи	547	3259	3259
<b>Общо приходи:</b>	<b>179 377</b>	<b>254 161</b>	<b>321 590</b>

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

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

Разходи	Стойност в лева	Стойност в лева	Стойност в лева
	30/06/2009	30/09/2009	30/12/2009
Разходи от операции с финансови активи	142 252	185 578	243 745
Отрицателни курсови разлики	0	32	3 968
Разходи за външни услуги	7 641	12 438	17 294
Други финансови разходи	1 115	1 485	2 685
<b>Общо разходи:</b>	<b>151 007</b>	<b>199 533</b>	<b>267 692</b>

Общият размер на разходите на фонда към 30.12.2009 г. е 267 692 лева, които включват 243 745 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 3 968 лв. разходи от отрицателни курсови разлики.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 30 декември 2009 – 13 373 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 30 декември 2009 – 1 462 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.20%

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 30 декември 2009 – 2 715 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.36%

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

- към 30 декември 2009 – 420 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.06%

д) Други разходи

- към 30 декември 2009 – 2 009 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.27%

- Други разходи по финансови операции: 1 223 лв.

- Външни услуги (КФН, ЦД и БФБ): 786 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 19 979 лв. към месец декември.

Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 2.69%.

За периода са записани 40.5171 дяла и са изкупени обратно 195.80 дяла. ИСА на фонда към 30.12.2009 г. е 781 154.96 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 38 519.0977.

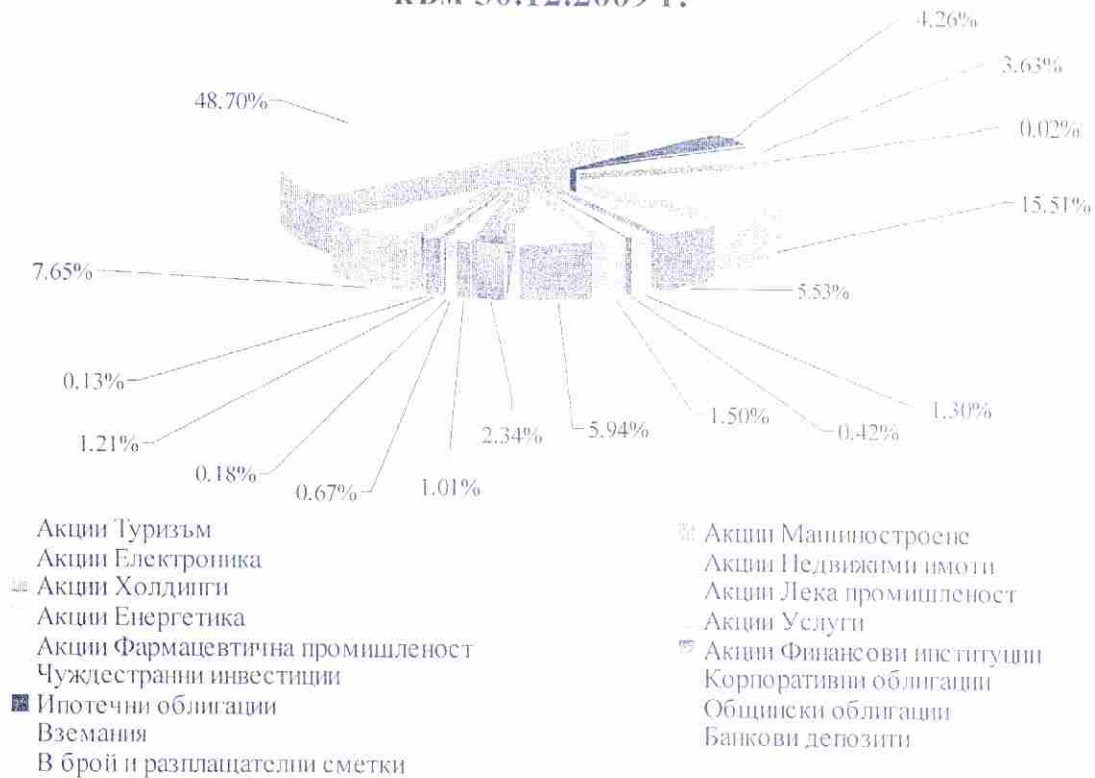
**3) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „в”: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти**

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 30.12.2009		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
Акции Туризм	10 205	1.30%
Акции Машиностроене	3 290	0.42%
Акции Електроника	11 732	1.50%
Акции Недвижими имоти	46 553	5.94%
Акции Холдинги	18 337	2.34%
Акции Лека промишленост	7 892	1.01%
Акции Енергетика	5 280	0.67%
Акции Услуги	1 422	0.18%
Акции Фармацевтична промишленост	9 492	1.21%
Акции Финансови институции	1 023	0.13%
Чуждестранни инвестиции	59 962	7.65%
Корпоративни облигации	381 669	48.70%
Ипотечни облигации	33 370	4.26%
Общински облигации	28 423	3.63%
Вземания	137	0.02%
Банкови депозити	121 516	15.51%
В брой и разплащателни сметки	43 361	5.53%
Общо активи	783 662	100.00%

\* Вземания във връзка с продажба на права.

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Съкровище  
към 30.12.2009 г.**

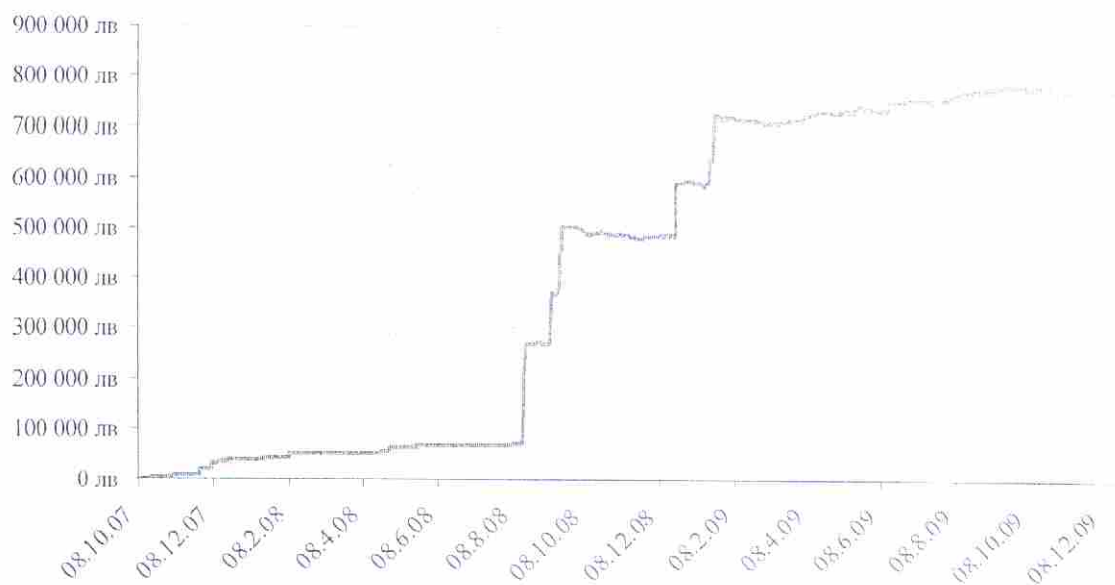


**4) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „б“: Нетна стойност на активите на един дял**

Към 30.12.2009 г. нетната стойност на активите на един дял е 20.2797 лв.

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

**Нетна стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище**



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

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.

**Рисков актив**

ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
Валутно деноминиран актив	USD	646.2230	23.6996	\$15 315.23

<b>Обща рискова позиция</b>	\$15 315.23
-----------------------------	-------------

**Дериватен инструмент**

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 12 000.00	1.47060	\$17 647.20	OTC	България

<b>Обща хеджираща позиция</b>	\$17 647.20
-------------------------------	-------------

Стоян Тошев  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

