



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 31.12.2013 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 31.12.2013 г. корпоративните облигации представляват 26.48% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище, като в активите на Фонда няма общински облигации и ипотечни облигации към 31.12.2013 г.

Към 31.12.2013 г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 45.36% от общите активи на Фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 18.52% от портфейла на Ти Би Ай Съкровище, като тези средства са предоставени на краткосрочен депозит във връзка с ограниченията за ликвидност на Фонда.

Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 6.38% от активите на Фонда към 31.12.2013 г.

Вземанията от начислено лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации възлизат на 3.26% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.12.2013 г. е 3.21% на годишна база*, а доходността за последните 12 месеца към 31.12.2013 г. е 14.28%.

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



Асет Мениджмънт

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 31.12.2013 г. Приходите са в размер на 62 312 лева, включващи приходи от операции с финансови активи, приходи от положителни курсови разлики, приходи от лихви и други финансови приходи.

НАИМЕНОВАНИЕ НА ПРИХОДИТЕ	Стойност в лева	
	30.06.2013	31.12.2013
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	47	76
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	33 258	56 158
Приходи от лихви	1 503	3 170
Други финансови приходи	1 893	2 908
ОБЩО ПРИХОДИ	36 701	62 312

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

НАИМЕНОВАНИЕ НА РАЗХОДИТЕ	Стойност в лева	
	30.06.2013	31.12.2013
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	86	125
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	25 079	46 385
Други разходи	166	210
Разходи за външни услуги	898	1 874
ОБЩО РАЗХОДИ	26 229	48 594

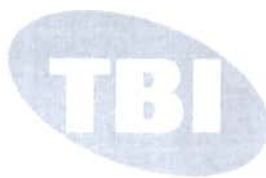
Общият размер на разходите на Фонда към 31.12.2013 г. е 48 594 лева, които включват 46 385 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти, 125 лева разходи от отрицателни курсови разлики, както и 2 084 лева разходи, представени подробно по-долу.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество
- към 31 декември 2013 – 1 874 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.79%

- б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество
- към 31 декември 2013 – 46 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.04%

- в) Други разходи
- към 31 декември 2013 – 164 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.16%

- е) Общ размер на всички разходи по букви а) – в) – 2 084 лв. за 2013 г. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 1.99%.



Асет Мениджмънт

	Стойност в лева	
	30.06.2013	31.12.2013
Общо приходи	36 701	62 312
Общо разходи	26 229	48 594
Нетен Резултат	10 472	13 718

За периода са записани 23.8129 дяла и са изкупени обратно 346.7407 броя дялове. ИСА на Фонда към 31.12.2012 г. е 102 133 лв., а към 31.12.2013 г. е 108 851 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 4 469.3780.

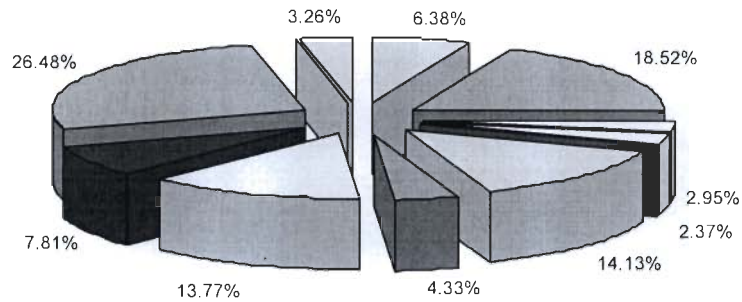
3) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5, б. „в” и „г”: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

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

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище					
Актив	Стойност в лева 31.12.2012	Процент от активите 31.12.2012	Стойност в лева 31.12.2013	Процент от активите 31.12.2013	Валута (EUR, USD, BGN)
В брой и разплащателни сметки	4 771	4.66%	6 956	6.38%	EUR, USD, BGN
Банкови депозити	12 277	12.00%	20 192	18.52%	EUR
Акции - Туризъм	2 650	2.59%	3 214	2.95%	BGN
Акции - Холдинги	7 467	7.30%	2 579	2.37%	BGN
Акции – Лека промишленост	-	0.00%	-	0.00%	BGN
Акции - Недвижими имоти	13 629	13.32%	15 408	14.13%	BGN
Акции - Енергетика	5 819	5.69%	4 718	4.33%	BGN
Акции – Фармацевтична промишленост	6 486	6.34%	15 004	13.77%	BGN
Акции – Тежка промишленост	9 088	8.88%	8 512	7.81%	BGN
Корпоративни облигации	31 543	30.83%	28 879	26.48%	EUR
Ипотечни облигации	3 927	3.84%	-	0.00%	EUR
Вземания *	4 659	4.55%	3 555	3.26%	BGN
Общо активи	102 316	100.00%	109 017	100.00%	

* Вземания във връзка с лихвено и главничко плащане по смисли корпоративни облигации.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Съкровище към 31/12/13



□ В брой и разплащателни сметки	□ Банкови депозити
□ Акции - Туризм	□ Акции - Холдинги
■ Акции - Лека промишленост	□ Акции - Недвижими имоти
▣ Акции - Енергетика	□ Акции - Фармацевтична промишленост
■ Акции - Тежка промишленост	□ Корпоративни облигации
□ Ипотечни облигации	□ Вземания *

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

Към 31.12.2012 г. нетната стойност на активите на един дял е в размер на 21.3118.
 На 30.06.2013 г. изчислената нетна стойност на активите на един дял е в размер на 23.6281.
 Към 31.12.2013 г. нетната стойност на активите на един дял е 24.3549 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 2011 в лева	Към 31 декември 2012 в лева	Към 31 декември 2013 в лева
Нетна стойност на активите	107 108	102 133	108 851
Нетна стойност на активите на един дял	20.6310	21.3118	24.3549

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

Към 31.12.2013 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

