

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 30.12.2010 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 30.12.2010 г. корпоративните облигации представляват 22.69% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище, а ипотечните облигации представляват 7.87% от общите активи на Фонда.

Към 30.12.2010 г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 24.54% от общите активи на фонда. Чуждестранните инвестиции са 15.82% от активите на Фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 17.31% от портфейла на Ти Би Ай Съкровище.

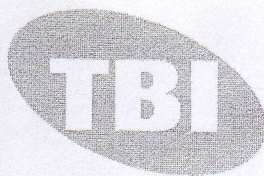
Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 10.78% от активите на Фонда към 30.12.2010 г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.12.2010 г. е 1.30%¹, доходността за последните 12 месеца към 30.12.2010г. е 2.84%, а доходността от началото на годината е 2.84%.

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 30.12.2010 г. Приходите са в размер на 487 424.67 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

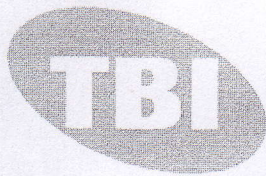
Приходи	Стойност в лева	Стойност в лева	Стойност в лева
	30/06/2010	30/09/2010	30/12/2010
Приходи от лихви	18 443	26 845	32 967
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	152 001	267 270	346 102
Положителни курсови разлики	41 081	72 057	104 378
Други финансови приходи	894	3 198	3 977
Общо приходи:	212 419	369 369	487 425

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

Разходи	Стойност в лева	Стойност в лева	Стойност в лева
	30/06/2010	30/09/2010	30/12/2010
Разходи от операции с финансови активи	161 717	254 867	339 133
Отрицателни курсови разлики	40 143	69 682	103 020
Разходи за външни услуги	9 528	14 399	18 244
Други финансови разходи	1 306	1 570	2 768
Общо разходи:	212 694	340 518	463 165

Общият размер на разходите на фонда към 30.12.2010 г. е 463 165.03 лева, които включват 339 133.11 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 103 020.33 лв. разходи от отрицателни курсови разлики.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество
 - към 30 декември 2010 – 13 229 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 2010 – 737 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.10%
- в) Възнаграждение на банката депозитар
 - към 30 декември 2010 – 3 623 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.49%
- г) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие
 - към 30 декември 2010 – 420 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.06%



Асет Мениджмънт

д) Други разходи

- към 30 декември 2010 – 3 003 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.41%

- Други разходи по финансови операции: 2 031 лв.

- Външни услуги (КФН, ЦД, БФБ и др.): 972 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 21 012 лв. към месец септември. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 2.86%.

За периода са записани 38.0687 дяла и са изкупени обратно 20 131.5796 дяла. НСА на фонда към 30.12.2010 г. е 323 318.37 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 15 503.0244.

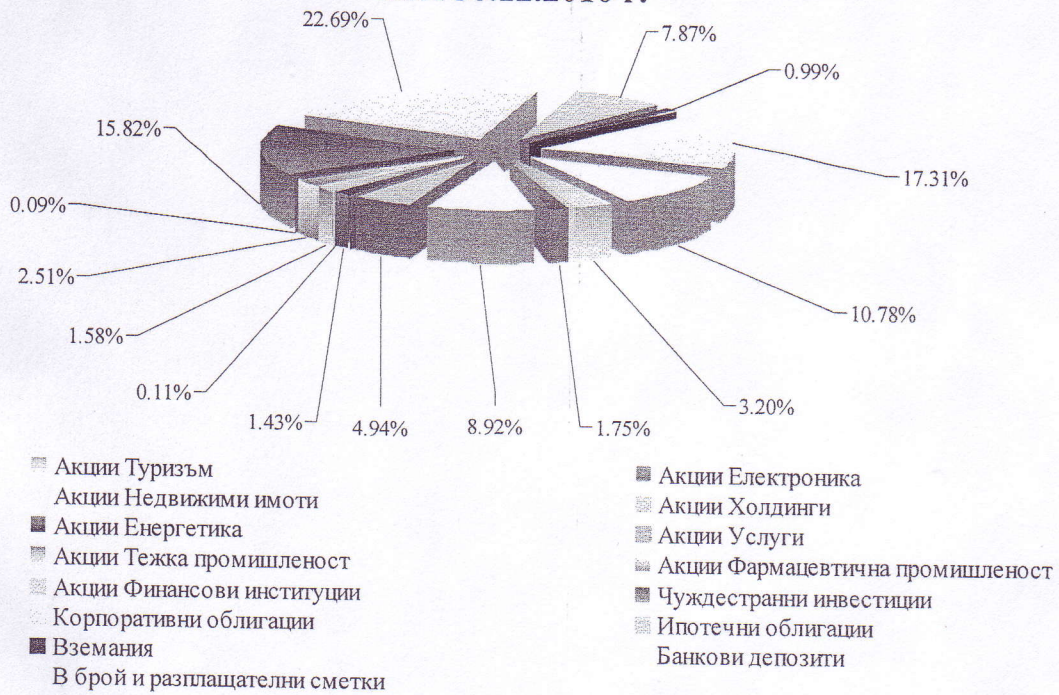
3) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „в“: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

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 30.12.2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
Акции Туризм	10 382	3.20%
Акции Електроника	5 688	1.75%
Акции Недвижими имоти	28 948	8.92%
Акции Холдинги	16 047	4.94%
Акции Енергетика	4 655	1.43%
Акции Услуги	355	0.11%
Акции Тежка промишленост	5 134	1.58%
Акции Фармацевтична промишленост	8 137	2.51%
Акции Финансови институции	297	0.09%
Чуждестранни инвестиции	51 355	15.82%
Корпоративни облигации	73 623	22.69%
Ипотечни облигации	25 540	7.87%
Вземания	3 223	0.99%
Банкови депозити	56 176	17.31%
В брой и разплащателни сметки	34 972	10.78%
Общо активи	324 533	100.00%

* Вземания във връзка с дивиденди и лихвено плащане.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Съкрѝвище към 30.12.2010 г.



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

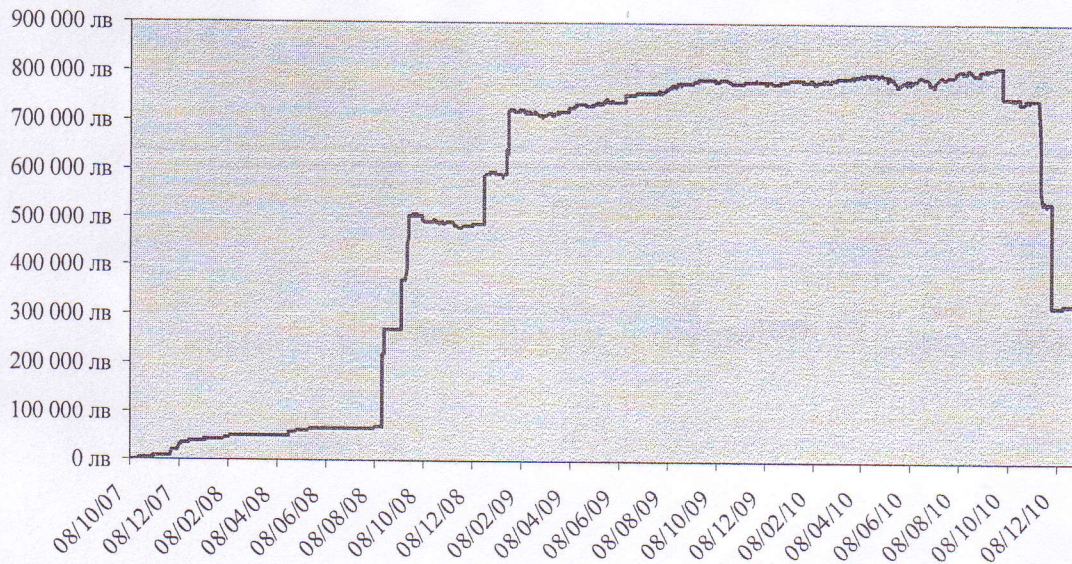
Към 30.12.2010 г. нетната стойност на активите на един дял е 20.8552.

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



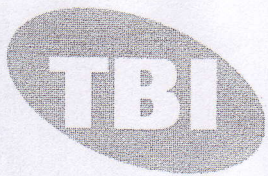
Асет Мениджмънт

Нетна стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище



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

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.



Асет Мениджмънт

Рисков актив

ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
валутно деноминиран актив	USD	642.1700	1.0000	\$642.17
валутно деноминиран актив	USD	230.0000	73.9487	\$17 008.20

Обща рискова позиция	\$17 650.37
-----------------------------	--------------------

Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 26 000.00	1.32949	\$34 566.74	OTC	България
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	-€ 13 000.00	1.33097	-\$17 302.61	OTC	България

Обща хеджираща позиция	\$17 264.13
-------------------------------	--------------------

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Мирослав Маринов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

