

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 30.06.2011 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 30.06.2011 г. корпоративните облигации представляват 37.22% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище, а ипотечните облигации представляват 7.08% от общите активи на Фонда.

Към 30.06.2011 г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 41.31% от общите активи на фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 10.41% от портфейла на Ти Би Ай Съкровище.

Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 1.40% от активите на Фонда към 30.06.2011 г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.06.2011 г. е 1.92%¹, доходността за последните 12 месеца към 30.06.2011 г. е 5.91%, а доходността от началото на годината е 2.95%.

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 30.06.2011 г. Приходите са в размер на 45 024.99 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 Менеджмънт

Приходи	Стойност в лева	Стойност в лева	Стойност в лева
	30/12/2010	31/03/2011	30/06/2011
Приходи от лихви	32 967	1 603	2 800
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	346 102	25 973	40 726
Положителни курсови разлики	104 378	1 152	1 181
Други финансови приходи	3977	2	318
Общо приходи:	487 425	28 729	45 025

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

Разходи	Стойност в лева	Стойност в лева	Стойност в лева
	30/12/2010	31/03/2011	30/06/2011
Разходи от операции с финансови активи	339 133	19 336	36 834
Отрицателни курсови разлики	103 020	1 235	1 275
Разходи за външни услуги	18 244	1 792	2 794
Други финансови разходи	2 768	342	450
Общо разходи:	463 165	22 705	41 353

Общият размер на разходите на фонда към 30.06.2011 г. е 41 353.16 лева, които включват 36 833.61 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 1 274.90 лв. разходи от отрицателни курсови разлики.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество
- към 30 юни 2011 – 1 070.31 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.87%

- б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество
- към 30 юни 2011 – 106.61 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.09%

- в) Възнаграждение на банката депозитар
- към 30 юни 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 31 март 2011 – 140 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.11%

- д) Други разходи
- към 30 юни 2011 – 727.37 лв.



Асет Мениджмънт

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.59%

- Други разходи по финансови операции: 343.83 лв.

- Външни услуги (КФН, ЦД и БФБ): 383.54 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 3 244.65 лв. към месец юни.

Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 2.63%.

За периода са записани 30.3204 дяла и са изкупени обратно 130.6571 дяла. НСА на фонда към 30.06.2011 г. е 110 429.26 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 5 143.4568.

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.

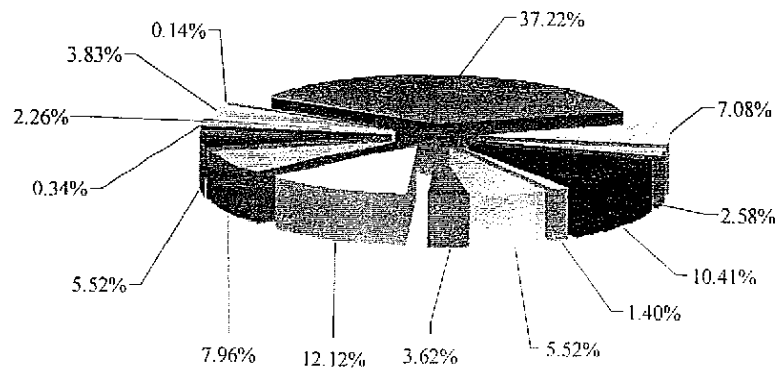
Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище към 30.06.2011		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
Акции Туризъм	6 121	5.52%
Акции Електроника	4 012	3.62%
Акции Недвижими имоти	13 429	12.12%
Акции Холдинги	8 819	7.96%
Акции Енергетика	6 121	5.52%
Акции Услуги	375	0.34%
Акции Тежка промишленост	2 502	2.26%
Акции Фармацевтична промишленост	4 239	3.83%
Акции Финансови институции	159	0.14%
Корпоративни облигации	41 241	37.22%
Ипотечни облигации	7 841	7.08%
Вземания	2 856	2.58%
Банкови депозити	11 533	10.41%
В брой и разплащателни сметки	1 556	1.40%
Общо активи	110 803	100.00%

* Вземания във връзка с предварително платени такси за БФБ, плащане на дивидент и вземания във връзка с увеличението на капитала на емисия BG1100039012.



Асет Мениджмънт

Разпределение на активите на Ти Би Ай Съкровище към 30.06.2011 г.



- Акции Туризъм
- Акции Недвижими имоти
- Акции Енергетика
- Акции Тежка промишленост
- Акции Финансови институции
- Ипотечни облигации
- Банкови 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

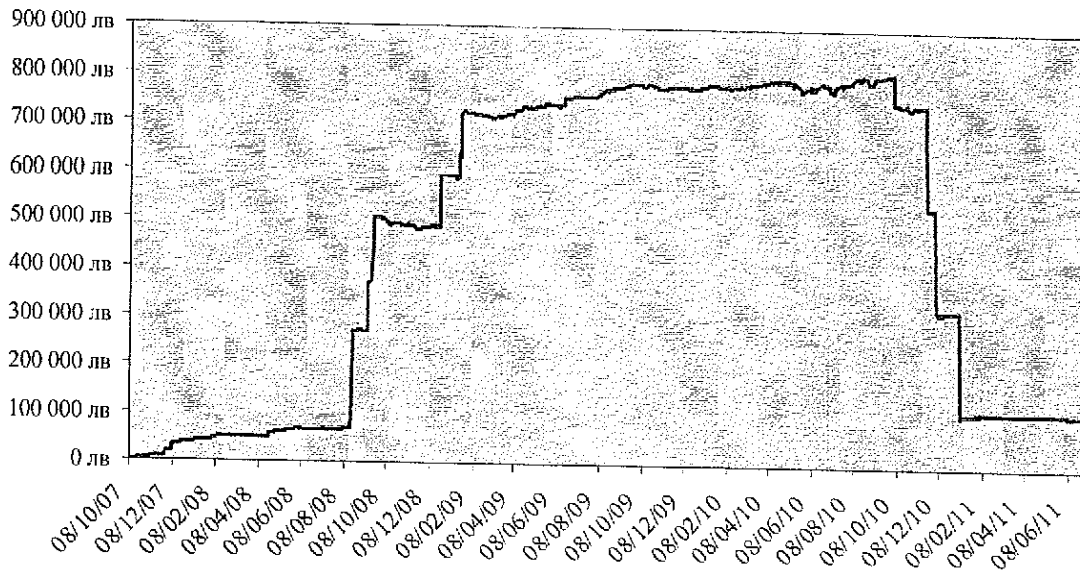
Към 30.06.2011 г. нетната стойност на активите на един дял е 21,4699.

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 30.06.2011 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