

**ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО  
ЧЛ. 73(1) Т.5 ОТ НАРЕДБА № 44 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА  
КОЛЕКТИВНИТЕ ИНВЕСТИЦИОННИ СХЕМИ, УПРАВЛЯВАЩИТЕ  
ДРУЖЕСТВА, ИНВЕСТИЦИОННИТЕ ДРУЖЕСТВА ОТ ЗАТВОРЕН ТИП  
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 31.12.2011 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 31.12.2011 г. корпоративните облигации представляват 40.27% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище. Ипотечните облигации представляват 9.13% от общите активи на Фонда, като в активите на Фонда няма общински облигации към 31.12.2011 г.

Към 31.12.2011 г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 32.31% от общите активи на фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 11.04% 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 6.85% от активите на Фонда към 31.12.2011 г.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации възлизат на 0, 40% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.12.2011 г. е 0.74% на годишна база\*, доходността за последните 12 месеца към 31.12.2011 г. е минус 1.08 %.

**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 31.12.2011 г. Приходите са в размер на 77 578 лева, включващи преценка от операции с финансови активи и приходи от лихви.

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



Приходи	Стойност в лева			
	31.03.2011	30.06.2011	30.09.2011	31.12.2011
Приходи от лихви	1 603	2 800	3 992	5 126
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	25 972	40 726	58 272	69 814
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	1 152	1 181	1 218	1 255
Други финансови приходи	2	318	1 381	1 383
<b>Общо приходи</b>	<b>28 729</b>	<b>45 025</b>	<b>64 863</b>	<b>77 578</b>

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

Разходи	Стойност в лева			
	31.03.2011	30.06.2011	30.09.2011	31.12.2011
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	19 336	36 834	58 666	72 497
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	1 235	1 275	1 300	1 329
Разходи за външни услуги	1 792	2 794	3 321	3 838
Други разходи	342	450	516	574
<b>Общо разходи</b>	<b>22 705</b>	<b>41 353</b>	<b>63 803</b>	<b>78 238</b>

Общият размер на разходите на фонда към 31.12.2011 г. е 78 238 лева, които включват 72 497 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 1 329 лв. разходи от отрицателни курсови разлики.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество  
 - към 31 декември 2011 – 2 054 лв.  
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.81%
- б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество  
 - към 31 декември 2011 – 122 лв.  
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.11%
- в) Възнаграждение на банката депозитар  
 - към 31 декември 2011 – 1 200 лв.  
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.06%
- г) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие  
 - към 31 декември 2011 – 140 лв.  
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.12%
- д) Други разходи  
 - към 31 декември 2011 – 896 лв.  
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.79%
- Други разходи по финансови операции: 452 лв.  
 - Външни услуги (КФН, ЦД, БФБ и др.): 444 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 4 412 лв. към месец декември. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са 3.89%.

	Стойност в лева			
	31.03.2011	30.06.2011	30.09.2011	31.12.2011
Общо Приходи	28 729	45 025	64 863	77 578
Общо Разходи	22 705	41 353	63 803	78 238
<b>Нетен Резултат</b>	<b>6 024</b>	<b>3 672</b>	<b>1 060</b>	<b>-660</b>

За периода са записани 119.3596 дяла и са изкупени обратно 10 430.7951 броя дялове. НСА на фонда към 31.12.2011 г. е 107 107.86 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 5 191.5889.

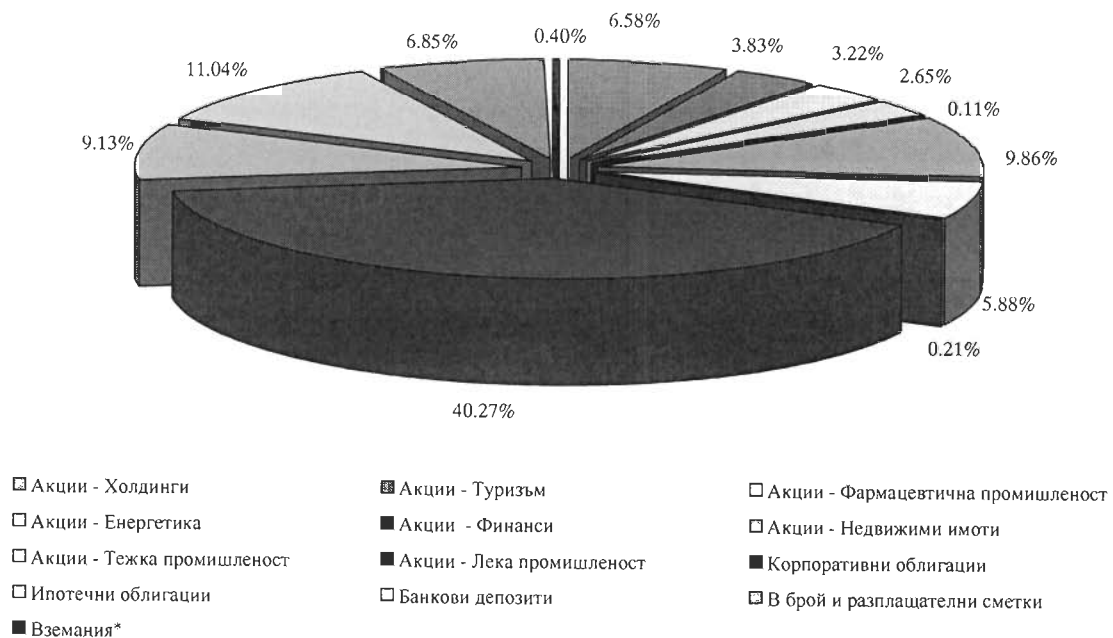
### 3. Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б. „в“ и „г“: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

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" към 31/12/2011					
Актив	Стойност в лева	Процент от активите	Стойност в лева	Процент от активите	Валута (EUR, USD, BGN)
	31.12.2010	31.12.2010	31.12.2011	31.12.2011	
Акции - Холдинги	16 047	4.94%	7 059	6.58%	BGN
Акции - Тютюнева промишленост	0	0.00%	0	0.00%	BGN
Акции - Туризм	10 382	3.20%	4 109	3.83%	BGN
Акции - Машиностроене	5 134	1.58%	0	0.00%	BGN
Акции - Фармацевтична промишленост	8 137	2.51%	3 451	3.22%	BGN
Акции - Енергетика	4 655	1.43%	2 843	2.65%	BGN
Акции - Финанси	0	0.00%	117	0.11%	BGN
Акции - Недвижими имоти	28 948	8.92%	10 579	9.86%	BGN
Акции - Тежка промишленост	0	0.00%	6 307	5.88%	BGN
Акции - Лека промишленост	355	0.11%	223	0.21%	BGN
Акции - Финанси	297	0.09%	0	0.00%	BGN
Акции - Миннодобивна промишленост	0	0.00%	0	0.00%	BGN
Акции - Електроника	5 689	1.75%	0	0.00%	BGN
Чуждестранни инвестиции	51 356	15.83%	0	0.00%	EUR
Корпоративни облигации	73 623	22.69%	43 223	40.27%	EUR
Ипотечни облигации	25 539	7.87%	9 804	9.13%	EUR
Банкови депозити	56 176	17.31%	11 851	11.04%	EUR
В брой и разплащателни сметки	34 972	10.78%	7 353	6.85%	BGN, EUR, USD
Вземания*	3 223	0.99%	424	0.40%	EUR, BGN
Общо активи	324 533	100.00%	107 343	100.00%	

\* Вземания във връзка с начислени дивиденди, лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, предварително платени такси към БФБ и КФН, вземания от хеджиране и др.

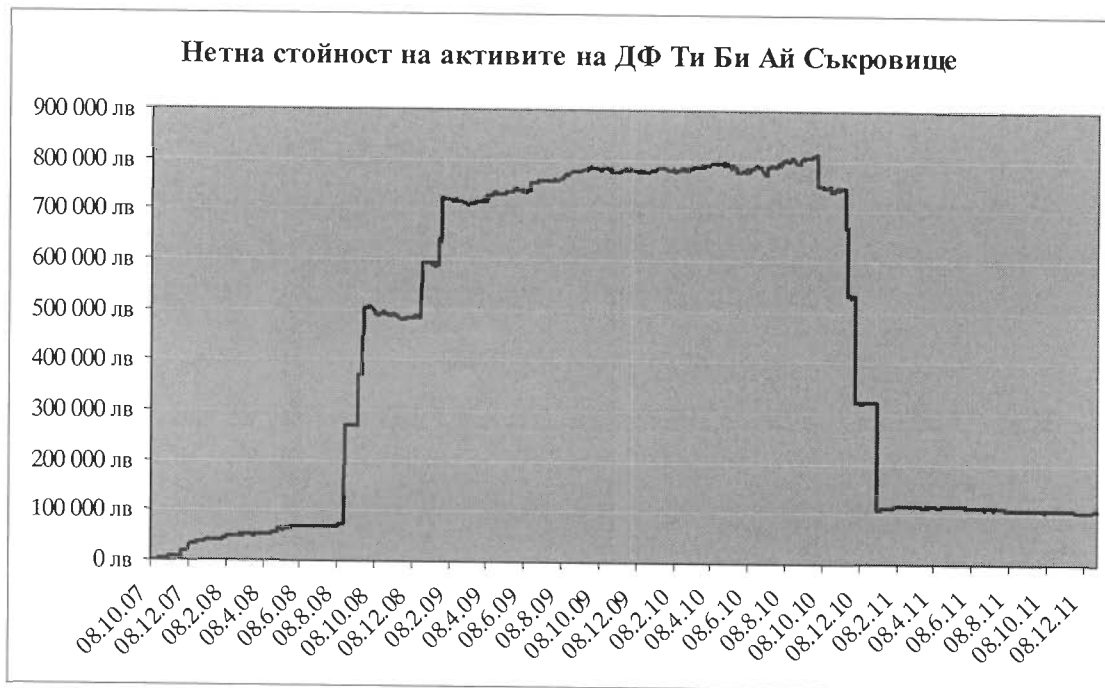
Разпределение на активите на Ти Би Ай Съкровище към 31/12/2011



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

На 31.03.2011 г. изчислената нетна стойност на активите на един дял е в размер на 21.9145. Към 30.06.2011 г. нетната стойност на активите на един дял е 21.4699. Към 30.09.2011 г. нетната стойност на активите на един дял е 20.9634. Към 31.12.2011 г. нетната стойност на активите на един дял е 20.6310 лв.

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



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

	Към 31 Декември 2009 (лева)	Към 31 Декември 2010 (лева)	Към 31 Декември 2011 (лева)
Нетна стойност на акитивите	781 155	323 318	107 108
Нетна стойност на акитивите на един дял	20.2797	20.8552	20.6310

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

Към 31.12.2011 г. Фондът не притежава активи, деноминирани във валута, различна от лева и евро, и поради тази причина няма сключени хеджиращи сделки.

Мирослав Маринов  
Исполнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

