

**ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО
ЧЛ. 75 т.2 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, във връзка с чл.75, т.2

1) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5, б. „г”: Промени в структурата на портфейла през отчетния период

Съгласно балансираната си инвестиционна политика и стратегия Фонда може да инвестира 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 първите шест месеца на 2012г. са закупени и продадени корпоративни облигации и акции на публични дружества, търгувани на БФБ – София АД.

Към 30.06.2012г. корпоративните облигации представляват 39.39% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище. Ипотечните облигации представляват 9.62% от общите активи на Фонда, като в активите на Фонда няма общински облигации към 30.06.2012г.

Към 30.06.2012г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 33.85% от общите активи на Фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 11.85% от портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище, като тези средства са предоставени на краткосрочен депозит с цел осигуряване на ликвидност на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.06.2012г. са 4.21% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с начислени дивиденди и лихвени плащания по две емисии корпоративни облигации възлизат на 1.08% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.06.2012г. е 0.42% на годишна база*. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 29.06.2012г. е минус 4.57%, а доходността от началото на годината е минус 1.12%.

2) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б. „а” и „д”: Промени в състоянието на активите в рамките на отчетния период

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

За периода са записани 38.4909 броя дялове и са обратно изкупени 252.3639 броя дялове. НСА на Фонда към 31.12.2011г. е 107 107.86 лв., а към 30.06.2012г. е 101 543.84 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 4 977.7159.

Долната таблица представя приходите на Фонда към 30.06.2012г. Приходите са в размер на 25 414 лв, включващи приходи от операции с финансови активи, приходи от лихви и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лева		
	30/06/2011	31/12/2011	30/06/2012
Приходи от лихви	2 800	5 126	2 369
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	40 726	69 814	21 724
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	1 181	1 255	55
Други финансови приходи	318	1 383	1 266
Общо приходи	45 025	77 578	25 414

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

Разходи	Стойност в лева		
	30/06/2011	31/12/2011	30/06/2012
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	36 834	72 497	25 529
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	1 275	1 329	65
Други разходи	2 794	3 838	107
Разходи за външни услуги	450	574	947
Общо разходи	41 353	78 238	26 648

Общият размер на разходите на фонда към 30.06.2012г. е 26 648 лева, които включват 25 529 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 65 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове,

а) Възнаграждение на управляващото дружество
 - към 30.06.2012г. – 947 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0,89%

б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество
 - към 30.06.2012г. – 10 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.01%

в) Други разходи
 - към 30.06.2012г. – 97 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.09%

- Други разходи по финансови операции: 97 лв.
 - Външни услуги (КФН, БФБ, ЦД и други услуги): 0 лв.

г) Общ размер на всички разходи по букви а) – в) – 1 054лв. към 30.06.2012г. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са 0.99%.

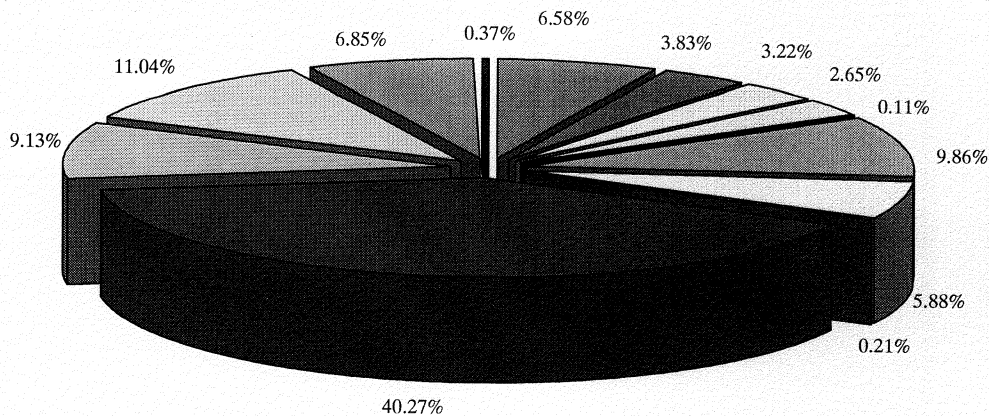
	Стойност в лева		
	30/06/2011	31/12/2011	30/06/2012
Общо Приходи	45 025	77 578	25 414
Общо Разходи	41 353	78 238	26 648
Нетен Резултат	3 672	-660	-1 234

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.

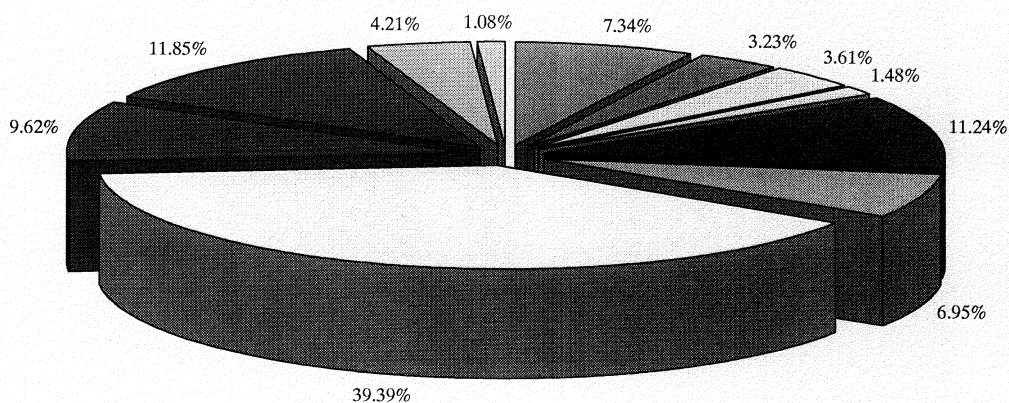
Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище към 31.12.2011 и 30.06.2012					
Актив	Стойност	Процент от активите	Стойност в	Процент от активите	Валута
	в лева		лева		
	31/12/2011	31/12/2011	30/06/2012	30/06/2012	
Корпоративни облигации	43 223	40.27%	40 105	39.39%	EUR
Ипотечни облигации	9 804	9.13%	9 790	9.62%	EUR
Акции - Туризм	4 109	3.83%	3 290	3.23%	BGN
Акции - Холдинги	7 059	6.58%	7 469	7.34%	BGN
Акции - Недвижими имоти	10 579	9.86%	11 454	11.24%	BGN
Акции - Енергетика	2 843	2.65%	1 506	1.48%	BGN
Акции - Фармацевтична промишленост	3 451	3.22%	3 678	3.61%	BGN
Акции - Тежка промишленост	6 307	5.88%	7 067	6.95%	BGN
Акции - Лека промишленост	223	0.21%	0	0.00%	BGN
Акции - Финанси	117	0.11%	0	0.00%	BGN
Банкови депозити	11 850	11.04%	12 059	11.85%	EUR
В брой и разплащателни сметки	7 353	6.85%	4 291	4.21%	EUR,BGN,USD
Вземания	425	0.37%	1 096	1.08%	EUR,BGN
Общо активи	107 343	100.00%	101 805	100.00%	

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



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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Съкровище към 30/06/2012

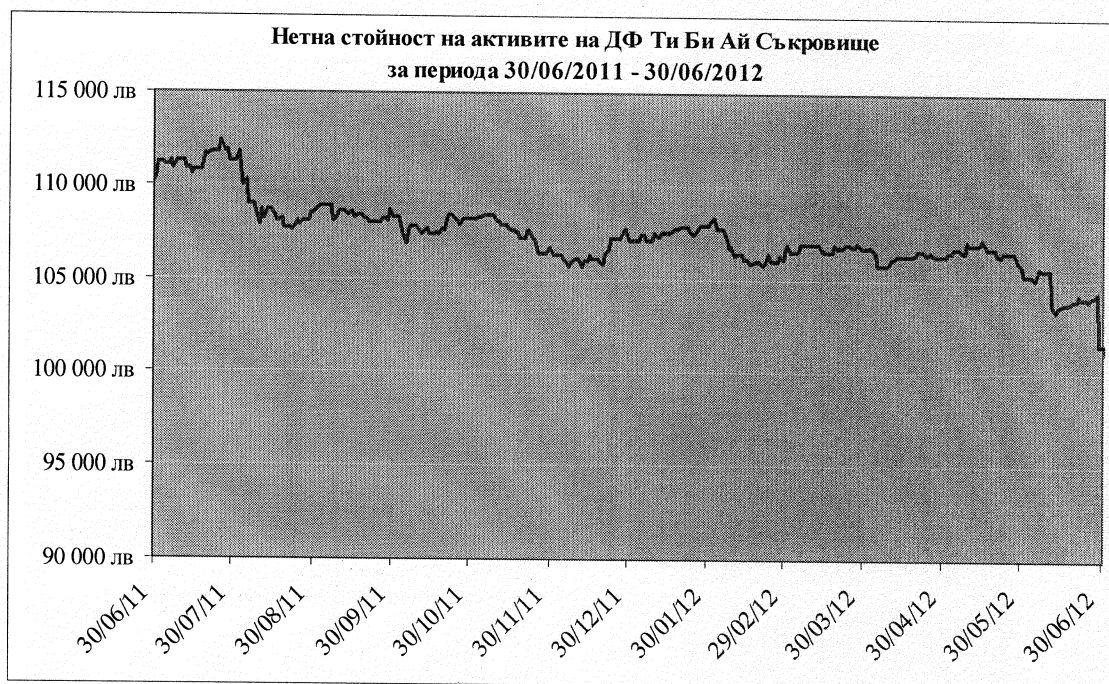


- | | | |
|---------------------------------|---------------------------|--------------------------------------|
| ■ Акции - Холдинги | ■ Акции - Туризм | □ Акции - Фармацевтична промишленост |
| □ Акции - Енергетика | ■ Акции - Недвижими имоти | ■ Акции - Тежка промишленост |
| □ Корпоративни облигации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

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

На 30.06.2011г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 21.4699 лв. На 31.12.2011г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 20.6310 лв.. Към 30.06.2012г. нетната стойност на активите на един дял е 20.3997 лв.

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



Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

