



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 30.09.2010 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 30.09.2010 г. корпоративните облигации представляват 35.86% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище. Ипотечните облигации представляват 4.18% от общите активи на Фонда, а общинските облигации – 4.19% от активите на Фонда.

Към 30.09.2010 г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 17.34% от общите активи на фонда. Чуждестранните инвестиции са 13.31% от активите на Фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 22.42% от портфейла на Ти Би Ай Съкровище.

Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 1.70% от активите на Фонда към 30.09.2010 г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.09.2010 г. е 1.69%¹, доходността за последните 12 месеца към 30.09.2010г. е 3.59%, а доходността от началото на годината е 3.69%.

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 30.09.2010 г. Приходите са в размер на 369 369.43 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.

TBI Асет Мениджмънт

Приходи	Стойност в лева	Стойност в лева	Стойност в лева
	31/03/2010	30/06/2010	30/09/2010
Приходи от лихви	9 552	18 443	26 845
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	63 455	152 001	267 270
Положителни курсови разлики	8 775	41 081	72 057
Други финансови приходи	152	894	3198
Общо приходи:	81 934	212 419	369 369

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

Разходи	Стойност в лева	Стойност в лева	Стойност в лева
	31/03/2010	30/06/2010	30/09/2010
Разходи от операции с финансови активи	59 545	161 717	254 867
Отрицателни курсови разлики	8 570	40 143	69 682
Разходи за външни услуги	4 735	9 528	14 399
Други финансови разходи	416	1 306	1 570
Общо разходи:	73 266	212 694	340 518

Общият размер на разходите на фонда към 30.09.2010 г. е 340 518.07 лева, които включват 254 867 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 69 682 лв. разходи от отрицателни курсови разлики.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество
 - към 30 септември 2010 – 10 635.39 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.35%
- б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество
 - към 30 септември 2010 – 351 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.04%
- в) Възнаграждение на банката депозитар
 - към 30 септември 2010 – 2 720 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.34%
- г) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие
 - към 30 септември 2010 – 315 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.04%
- д) Други разходи
 - към 30 септември 2010 – 1 947 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.25%



Асет Мениджмънт

- Други разходи по финансови операции: 1 218 лв.
- Външни услуги (КФН, ЦД и БФБ): 729 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 15 969 лв. към месец септември. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 2.02%.

За периода са записани 44.6327 дяла и са изкупени обратно 3075.6081 дяла. НСА на фонда към 30.09.2010 г. е 748 498.48лв. Броят дялове към края на отчетния период е 35 596.5353.

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 30.09.2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
Акции Туризм	16 634	2.04%
Акции Машиностроене	3 585	0.44%
Акции Електроника	11 681	1.43%
Акции Недвижими имоти	50 699	6.22%
Акции Холдинги	28 693	3.52%
Акции Енергетика	6 993	0.86%
Акции Услуги	804	0.10%
Акции Тежка промишленост	12 109	1.49%
Акции Фармацевтична промишленост	9 452	1.16%
Акции Финансови институции	627	0.08%
Чуждестранни инвестиции	108 457	13.31%
Корпоративни облигации	292 244	35.86%
Ипотечни облигации	34 043	4.18%
Общински облигации	34 123	4.19%
Вземания	8 224	1.01%
Банкови депозити	182 706	22.42%
В брой и разплащателни сметки	13 847	1.70%
Общо активи	814 921	100.00%

* Вземания във връзка с предварително платени такси за БФБ, ЦД, КФН, плащане на дивиденди и лихвено плащане, както и вземания от хеджиране.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Съкровище към 30.09.2010 г.



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

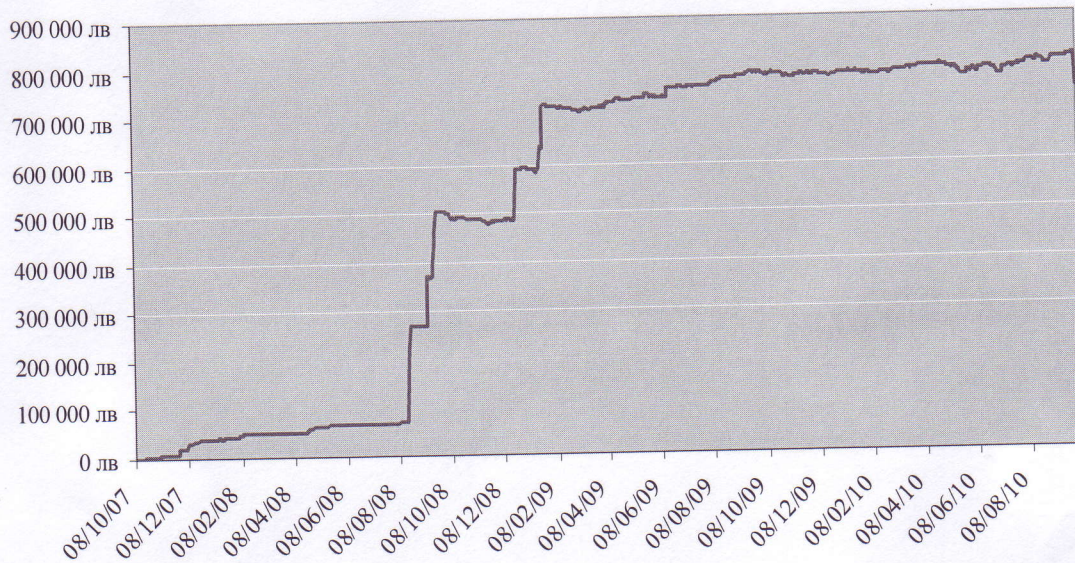
Към 30.09.2010 г. нетната стойност на активите на един дял е 21.0273лв.

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.

Рисков актив

ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
валутно деноминиран актив	USD	230.0000	74.6299	\$17 164.88
валутно деноминиран актив	USD	390.0000	42.8949	\$16 729.01
валутно деноминиран актив	USD	700.0000	39.6200	\$27 734.00
Обща рискова позиция				\$61 627.89

Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 48 000.00	1.26801	\$60 864.48	ОТС	България
Обща хеджираща позиция				\$60 864.48		

Стоян Тошев
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

