



ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО

ЧЛ. 73(1) т.5 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

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 31.12.2012 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 31.12.2012 г. корпоративните облигации представляват 30.83% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище. Ипотечните облигации представляват 3.84% от общите активи на Фонда, като в активите на Фонда няма общински облигации към 31.12.2012 г.

Към 31.12.2012 г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 44.12% от общите активи на фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 12.00% 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 4.66% от активите на Фонда към 31.12.2012 г.

Вземанията от начислено лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации възлизат на 4.55% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.12.2012 г. е 1.22% на годишна база*, а доходността от началото на годината и доходността за последните 12 месеца към 31.12.2012 г. е 3.30%.

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



Асет Мениджмънт

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 31.12.2012 г. Приходите са в размер на 56 805 лева, включващи приходи от операции с финансови активи, приходи от лихви и други финансови приходи.

НАИМЕНОВАНИЕ НА ПРИХОДИТЕ	Стойност в лева	
	30.6.2012	31.12.2012
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	55	97
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	21 724	50 671
Приходи от лихви	2 369	4 330
Други финансови приходи	1 266	1 707
ОБЩО ПРИХОДИ	25 414	56 805

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

НАИМЕНОВАНИЕ НА РАЗХОДИТЕ	Стойност в лева	
	30.6.2012	31.12.2012
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	65	138
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	25 529	51 393
Други разходи	107	207
Разходи за външни услуги	947	1 867
ОБЩО РАЗХОДИ	26 648	53 605

Общият размер на разходите на фонда към 31.12.2012 г. е 53 605 лева, които включват 51 393 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 138 лева разходи от отрицателни курсови разлики.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество
- към 31 декември 2012 – 1 867 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 31 декември 2012 – 25 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.02%

- в) Други разходи
- към 31 декември 2012 – 182 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.18%

- е) Общ размер на всички разходи по букви а) – в) – 2 074 лв. към месец декември.
Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 2.00%.



Асет Менѝджмънт

	Стойност в лева	
	30/06/2012	31/12/2012
Общо Приходи	25 414	56 805
Общо Разходи	26 648	53 605
Нетен Резултат	-1 234	3 200

За периода са записани 46.4202 дяла и са изкупени обратно 445.7033 броя дялове. НСА на фонда към 31.12.2012 г. е 102 132.67 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 4 792.3058.

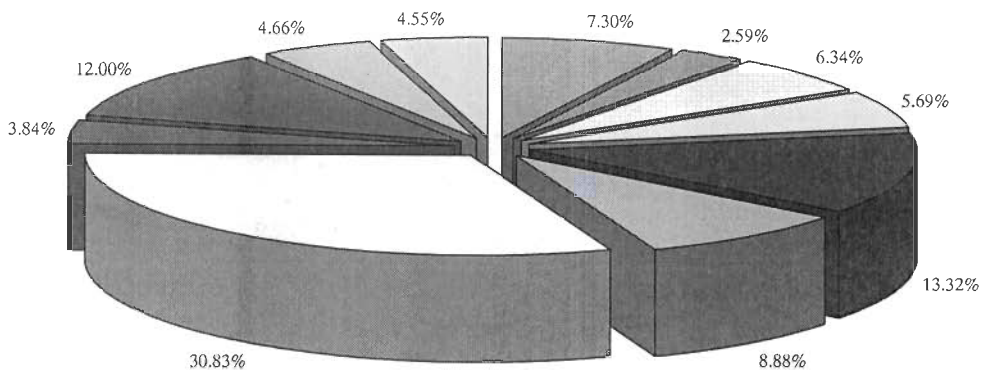
3) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5, б. „в” и „г”: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

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					
Актив	Стойност в лева 31.12.2011	Процент от активите 31.12.2011	Стойност в лева 31.12.2012	Процент от активите 31.12.2012	Валута (EUR, USD, BGN)
В брой и разплащателни сметки	7 353	6.85%	4 771	4.66%	EUR, USD, BGN
Банкови депозити	11 850	11.04%	12 277	12.00%	EUR
Акции - Туризм	4 109	3.83%	2 650	2.59%	BGN
Акции - Холдинги	7 059	6.58%	7 467	7.30%	BGN
Акции – Лека промишленост	223	0.21%	0	0.00%	BGN
Акции - Недвижими имоти	10 579	9.86%	13 629	13.32%	BGN
Акции - Енергетика	2 843	2.65%	5 819	5.69%	BGN
Акции – Фармацевтична промишленост	3 451	3.22%	6 486	6.34%	BGN
Акции – Тежка промишленост	6 307	5.88%	9 088	8.88%	BGN
Акции - Финанси	117	0.11%	0	0.00%	BGN
Корпоративни облигации	43 223	40.27%	31 543	30.83%	EUR
Ипотечни облигации	9 804	9.13%	3 927	3.84%	EUR
Вземания *	425	0.37%	4 659	4.55%	BGN
Общо активи	107 343	100.00%	102 316	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 31/12/2012



- | | | |
|--|---|---|
| <input checked="" type="checkbox"/> Акции - Холдинги | <input checked="" type="checkbox"/> Акции - Туризм | <input type="checkbox"/> Акции - Фармацевтична промишленост |
| <input type="checkbox"/> Акции - Енергетика | <input checked="" type="checkbox"/> Акции - Недвижими имоти | <input type="checkbox"/> Акции - Тежка промишленост |
| <input type="checkbox"/> Корпоративни облигации | <input checked="" type="checkbox"/> Ипотечни облигации | <input checked="" type="checkbox"/> Банкови депозити |
| <input type="checkbox"/> В брой и разплащателни сметки | <input type="checkbox"/> Вземания* | |

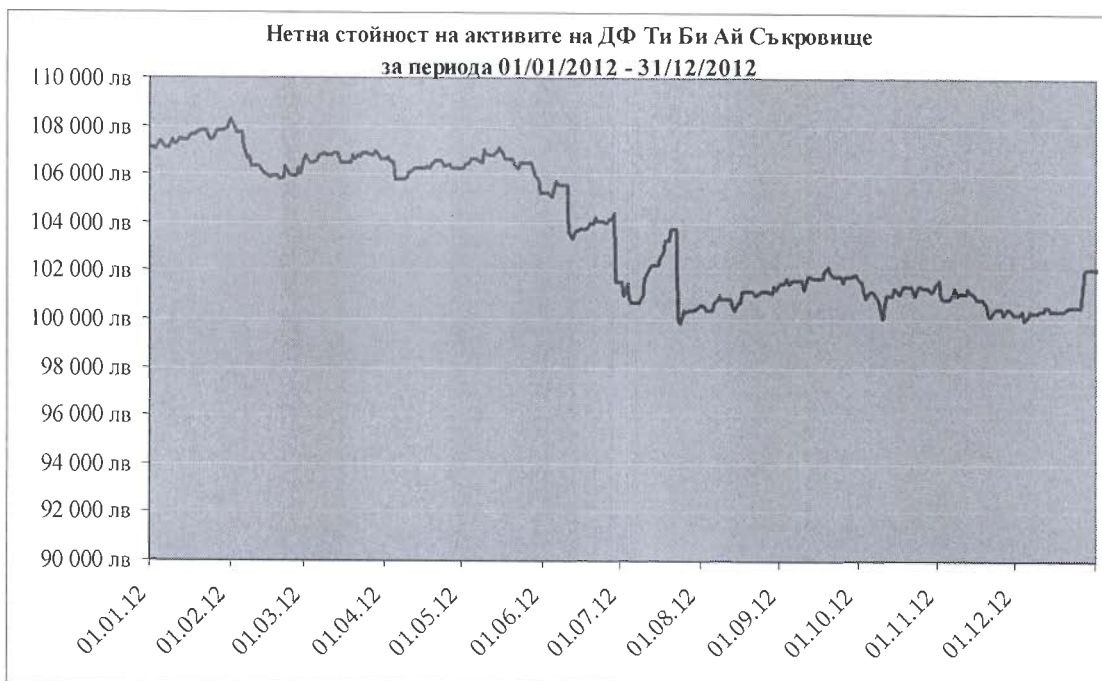
4) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5, б. „б“: Нетна стойност на активите на един дял

На 30.06.2012 г. изчислената нетна стойност на активите на един дял е в размер на 20,3997. Към 31.12.2012 г. нетната стойност на активите на един дял е 21,3118 лв.

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



Асет Мениджмънт



- 5) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 6, б. „е“: Сравнителна таблица за последните три финансови години, включваща общата стойност на нетните активи и нетна стойност на един дял

	31/12/2010 (лв)	31/12/2011 (лв)	31/12/2012 (лв)
Нетна стойност на активите на ДФ „Ти Би Ай Съкровище“	323 318,37	107 107,86	102 132,67
Нетна стойност на активите на един дял	20,8552	20,6310	21,3118

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

Към 31.12.2012 г. Фондът не притежава активи, деноминирани във валута, различна от лева и евро, и поради тази причина няма сключени хеджиращи сделки.

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

