

ИНФОРМАЦИЯ
СЪГЛАСНО ЧЛ. 72 ОТ НАРЕДБА № 44 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ
ДЕЙНОСТТА НА КИС, ИД ОТ ЗАТВОРЕН ТИП И УД

ДФ ТИ БИ АЙ СЪКРОВИЩЕ

Фондът следва балансирана инвестиционна политика, според която може да инвестира до 60% от активите си в дългови ценни книжа и до 60% в акции, както и до 20% от активите си в дялове на колективни инвестиционни схеми. През периода са закупени и продадени акции от български публични дружества, търгувани на БФБ – София АД.

Към 31.10.2012 г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище са разпределени в 6 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 31.10.2012 г. възлиза на 36.81%.

Към 31.10.2012 г. корпоративните облигации представляват 32.10% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище, а ипотечните облигации 9.95% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 12.01% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.10.2012 г. са 4.46% от стойността на портфейла.

Вземанията от начислени дивиденди, лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации възлизат на 4.67% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.10.2012 г. е 1.13% на годишна база*, доходността от началото на годината е 2.63%, а доходността за последните 12 месеца към 31.10.2012г. е 1.24%.

I. Данни по чл. 72, ал. 2 от Наредба № 44

1) Данни по чл. 72, ал. 2 т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти

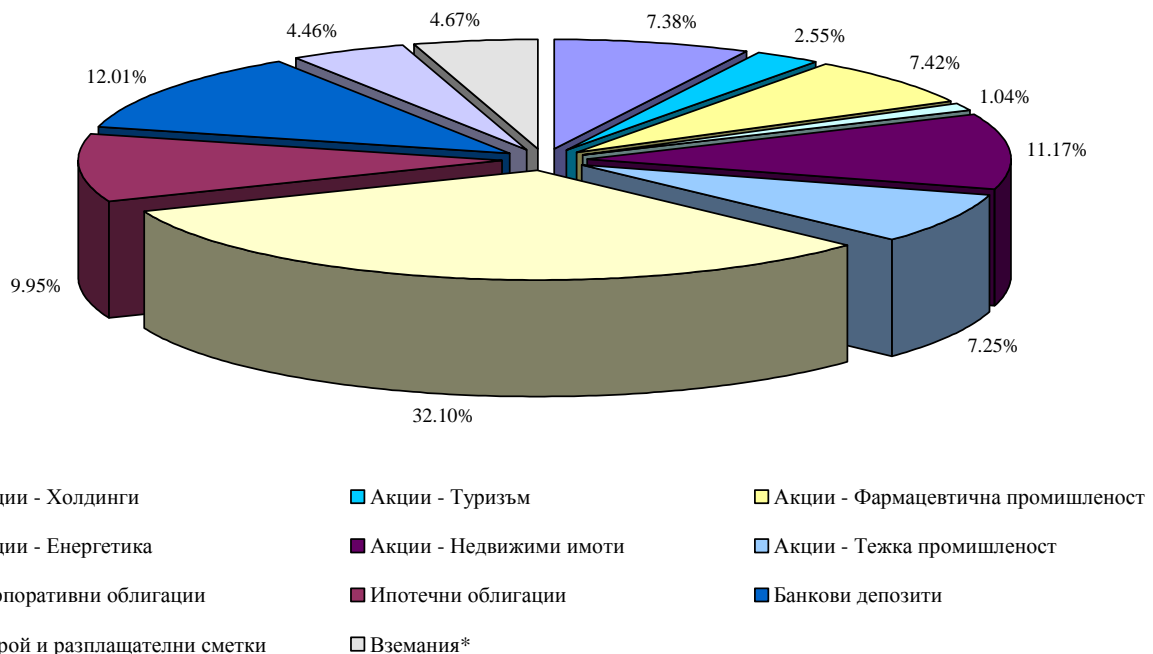
* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище към 31.10.2012г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ "Ти Би Ай Съкровище" към 31/10/2012		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	7 496	7.38%
Акции - Туризм	2 596	2.55%
Акции - Фармацевтична промишленост	7 546	7.42%
Акции - Енергетика	1 058	1.04%
Акции - Недвижими имоти	11 354	11.17%
Акции - Тежка промишленост	7 367	7.25%
Корпоративни облигации	32 625	32.10%
Ипотечни облигации	10 107	9.95%
Банкови депозити	12 205	12.01%
В брой и разплащателни сметки	4 536	4.46%
Вземания*	4 742	4.67%
Общо активи	101 632	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 31/10/2012



2) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 2: Видове деривативни инструменти, основни рискове, свързани с базовите активи на деривативните инструменти, количествени ограничения и избрани методи за оценка на риска, свързан със сделките с деривативни инструменти

Към 31.10.2012 г. Фондът не притежава деривативни финансови инструменти в портфейла си.

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД