

**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. Закупени са и са продадени акции от български публични дружества, търгувани на БФБ – София АД. През периода са продадени и корпоративни облигации.

Към 31.05.2012 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 31.05.2012 г. възлиза на 32.26%.

Към 31.05.2012 г. корпоративните облигации представляват 38.13% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище, а ипотечните облигации 9.65% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 11.40% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.05.2012 г. са 7.60% от стойността на портфейла.

Вземанията от начислени дивиденди, лихвено и главнично плащане по емисия корпоративни облигации възлизат на 0.96% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.05.2012 г. е 0.14% на годишна база\*, доходността от началото на годината е минус 2.43%, а доходността за последните 12 месеца към 31.05.2012г. е минус 6.86%.

**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**

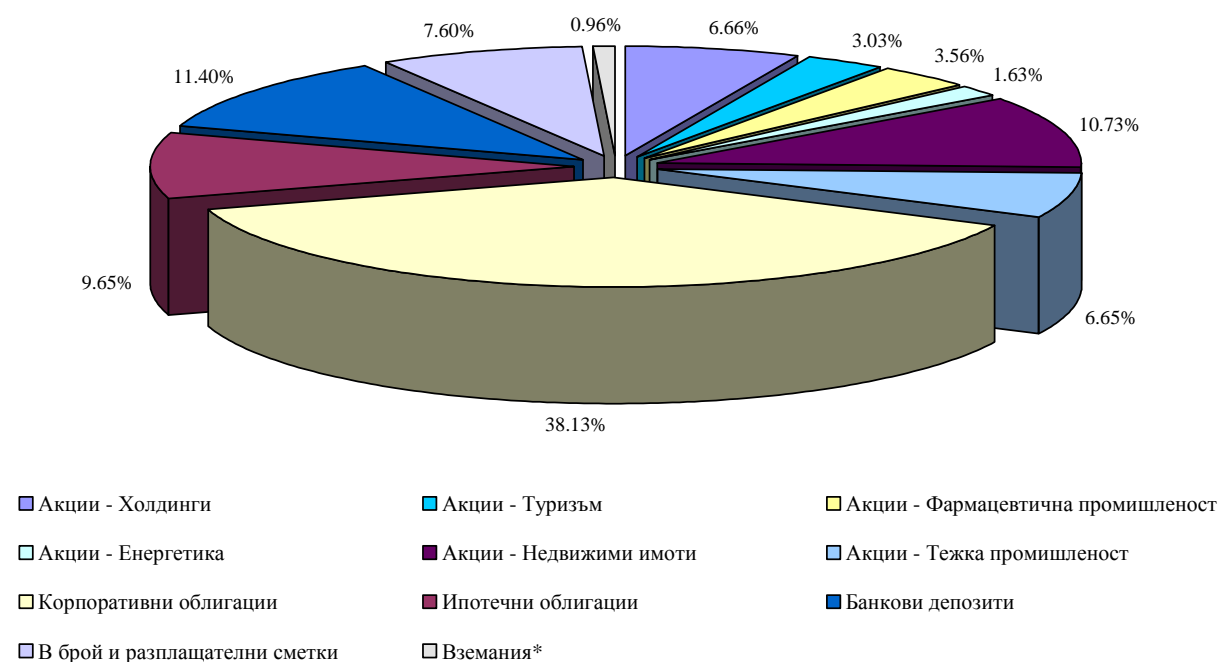
\* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище към 31.05.2012г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ "Ти Би Ай Съкровище" към 31/05/2012		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	7 018	6.66%
Акции - Туризмъ	3 195	3.03%
Акции - Фармацевтична промишленост	3 759	3.56%
Акции - Енергетика	1 714	1.63%
Акции - Недвижими имоти	11 323	10.73%
Акции - Тежка промишленост	7 011	6.65%
Корпоративни облигации	40 205	38.13%
Ипотечни облигации	10 172	9.65%
Банкови депозити	12 025	11.40%
В брой и разплащателни сметки	8 013	7.60%
Вземания*	1 016	0.96%
Общо активи	105 451	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 31/05/2012



**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 31.05.2012 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