

**ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО  
ЧЛ. 73Г ОТ НАРЕДБА № 25 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА  
ИНВЕСТИЦИОННИТЕ ДРУЖЕСТВА И ДОГОВОРНИ ФОНДОВЕ ЗА ДОГОВОРЕН  
ФОНД „ТИ БИ АЙ СЪКРОВИЩЕ”**

**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, както и дялове на взаимни фондове с експозиция към европейските капиталови пазари.

Към 30.12.2009 г. корпоративните облигации представляват 48.70% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище. Ипотечните облигации представляват 4.26% от общите активи на Фонда, а общинските облигации – 3.63% от активите на Фонда.

Към 30.12.2009 г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 14.70% от общите активи на фонда. Взаимните фондове са 7.65% от активите на Фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 15.51% от портфейла на Ти Би Ай Съкровище.

Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 5.53% от активите на Фонда към 30.12.2009 г.

**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 31.12.2009 г. Приходите са в размер на 321 590 лева, включващи преоценка от операции с финансови активи и приходи от лихви.

Приходи	Стойност в лева	Стойност в лева	Стойност в лева
	30/06/2009	30/09/2009	30/12/2009
Приходи от лихви	19 492	30 639	40 917
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	159 338	220 263	273 609
Положителни курсови разлики	0	0	3 805
Други финансови приходи	547	3259	3259
<b>Общо приходи:</b>	<b>179 377</b>	<b>254 161</b>	<b>321 590</b>

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

Разходи	Стойност в лева	Стойност в лева	Стойност в лева
	30/06/2009	30/09/2009	30/12/2009
Разходи от операции с финансови активи	142 252	185 578	243 745
Отрицателни курсови разлики	0	32	3 968
Разходи за външни услуги	7 641	12 438	17 294
Други финансови разходи	1 115	1 485	2 685
<b>Общо разходи:</b>	<b>151 007</b>	<b>199 533</b>	<b>267 692</b>

Общият размер на разходите на фонда към 30.12.2009 г. е 267 692 лева, които включват 243 745 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 3 968 лв. разходи от отрицателни курсови разлики.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество
  - към 30 декември 2009 – 13 373 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 30 декември 2009 – 1 462 лв.
  - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.20%
- в) Възнаграждение на банката депозитар
  - към 30 декември 2009 – 2 715 лв.
  - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.36%
- г) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие
  - към 30 декември 2009 – 420 лв.
  - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.06%
- д) Други разходи
  - към 30 декември 2009 – 2 009 лв.
  - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.27%
  - Други разходи по финансови операции: 1 223 лв.
  - Външни услуги (КФН, ЦД и БФБ): 786 лв.
- е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 19 979 лв. към месец декември. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 2.69%.

За периода са записани 7 516.7195 дяла и са изкупени обратно 342.3745 броя дялове. НСА на фонда към 31.12.2009 г. е 781 155 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 38 519.0977.

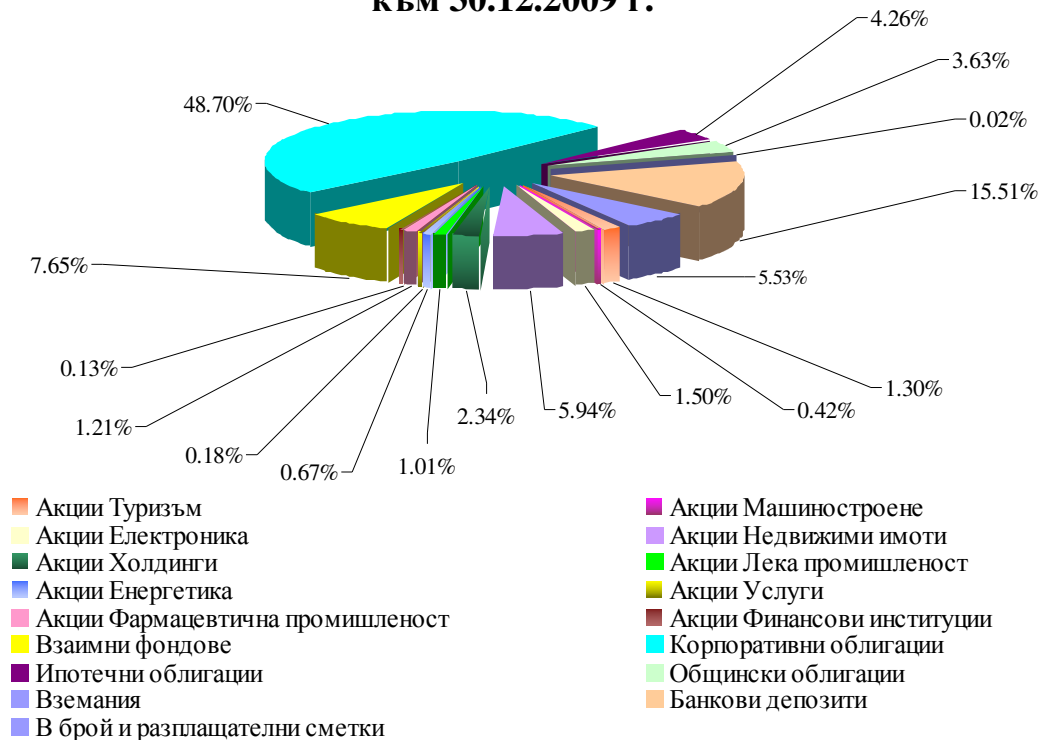
**3) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „в”: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти**

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище в края на периода е представена в следната таблица и графика.

<b>Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище към 30.12.2009</b>		
<b>Актив</b>	<b>Стойност в лева</b>	<b>Процент от активи</b>
Акции Туризъм	10 205	1.30%
Акции Машиностроене	3 290	0.42%
Акции Електроника	11 732	1.50%
Акции Недвижими имоти	46 553	5.94%
Акции Холдинги	18 337	2.34%
Акции Лека промишленост	7 892	1.01%
Акции Енергетика	5 280	0.67%
Акции Услуги	1 422	0.18%
Акции Фармацевтична промишленост	9 492	1.21%
Акции Финансови институции	1 023	0.13%
Взаимни фондове	59 962	7.65%
Корпоративни облигации	381 669	48.70%
Ипотечни облигации	33 370	4.26%
Общински облигации	28 423	3.63%
Вземания	137	0.02%
Банкови депозити	121 516	15.51%
В брой и разплащателни сметки	43 361	5.53%
<b>Общо активи</b>	<b>783 662</b>	<b>100.00%</b>

\* Вземания във връзка с продажба на права.

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Съкровище  
към 30.12.2009 г.**

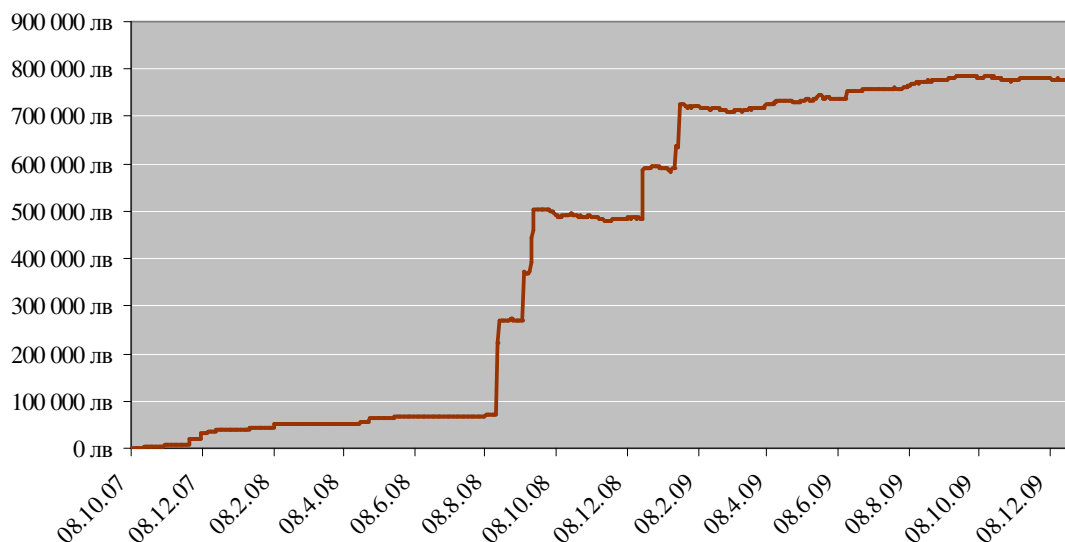


**4) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „б“: Нетна стойност на активите на един дял**

Към 31.12.2009 г. нетната стойност на активите на един дял е 20.2797 лв.

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

**Нетна стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище**



5) Данни по чл. 73г, 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

	Към 31 Декември 2007	Към 31 Декември 2008	Към 31 Декември 2009
Нетна стойност на активите	39 371	593 092	781 155
Нетна стойност на активите на един дял	20.6420	18.9216	20.2797

б) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „ж“: Задължения, възникнали от сделки с деривативни инструменти по чл. 195, ал. 1, т. 7 от ЗППЦК

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
LU0066757435	USD	646.2230	23.6996	\$15 315.23

Обща рискова позиция	\$15 315.23
----------------------	-------------

**Дериватен инструмент**

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 12 000.00	1.47060	\$17 647.20	OTC	България

Обща хеджираща позиция	\$17 647.20
------------------------	-------------

Стоян Тошев  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД