



Асет Мениджмънт

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 30.12.2010 г. корпоративните облигации представляват 22.69% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище. Ипотечните облигации представляват 7.87% от общите активи на Фонда, като в активите на Фонда няма общински облигации към 30.12.2010 г..

Към 30.12.2010 г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 24.54% от общите активи на фонда. Взаимните фондове са 15.82% от активите на Фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 17.31% от портфейла на Ти Би Ай Съкровище.

Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 10.78% от активите на Фонда към 30.12.2010 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 30.12.2010 г. Приходите са в размер на 487 424 лева, включващи преценка от операции с финансови активи и приходи от лихви.

Приходи	Стойност в лева	Стойност в лева	Стойност в лева
	30/06/2010	30/09/2010	30/12/2010
Приходи от лихви	18 443	26 845	32 967
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	152 001	267 270	346 102
Положителни курсови разлики	41 081	72 057	104 378
Други финансови приходи	894	3 198	3 977
Общо приходи:	212 419	369 369	487 424

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



Асет Мениджмънт

Разходи	Стойност в лева	Стойност в лева	Стойност в лева
	30/06/2010	30/09/2010	30/12/2010
Разходи от операции с финансови активи	161 717	254 867	339 133
Отрицателни курсови разлики	40 143	69 682	103 020
Разходи за външни услуги	9 528	14 399	18 244
Други финансови разходи	1 306	1 570	2 768
Общо разходи:	212 694	340 518	463 165

Общият размер на разходите на фонда към 30.12.2010 г. е 463 165 лева, които включват 339 133 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 103 020 лв. разходи от отрицателни курсови разлики.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество
 - към 30 декември 2010 – 13 229 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 2010 – 737 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.10%

- в) Възнаграждение на банката депозитар
 - към 30 декември 2010 – 3 623 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.49%

- г) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие
 - към 30 декември 2010 – 420 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.06%

- д) Други разходи
 - към 30 декември 2010 – 3 003 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.41%

 - Други разходи по финансови операции: 2 031 лв.
 - Външни услуги (КФН, ЦД, БФБ и др.): 972 лв.

- е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 21 012 лв. към месец декември. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 2.86%.

За периода са записани 227.3935 дяла и са изкупени обратно 23 243.4668 броя дялове. НСА на фонда към 30.12.2010 г. е 323 318 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 15 503.0244.



Асет Мениджмънт

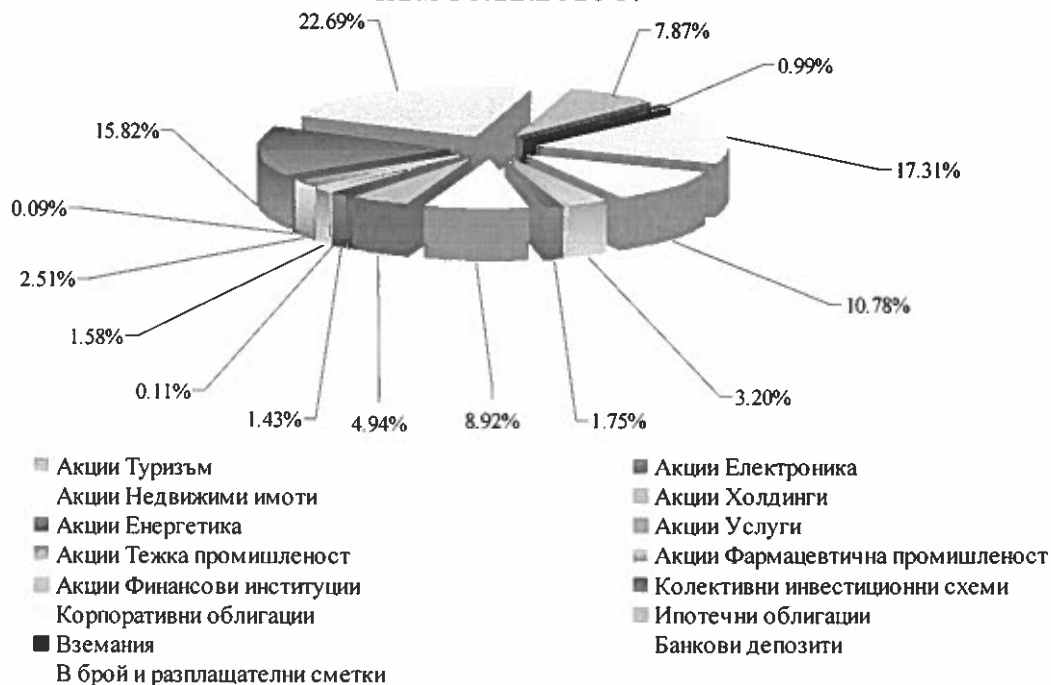
3) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „в“: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

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 30.12.2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
Акции Туризм	10 382	3.20%
Акции Електроника	5 688	1.75%
Акции Недвижими имоти	28 948	8.92%
Акции Холдинги	16 047	4.94%
Акции Енергетика	4 655	1.43%
Акции Услуги	355	0.11%
Акции Тежка промишленост	5 134	1.58%
Акции Фармацевтична промишленост	8 137	2.51%
Акции Финансови институции	297	0.09%
Колективни инвестиционни схеми	51 355	15.82%
Корпоративни облигации	73 623	22.69%
Ипотечни облигации	25 540	7.87%
Вземания	3 223	0.99%
Банкови депозити	56 176	17.31%
В брой и разплащателни сметки	34 972	10.78%
Общо активи	324 533	100.00%

* Вземания във връзка с дивиденди и лихвено плащане.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Съкровище към 30.12.2010 г.

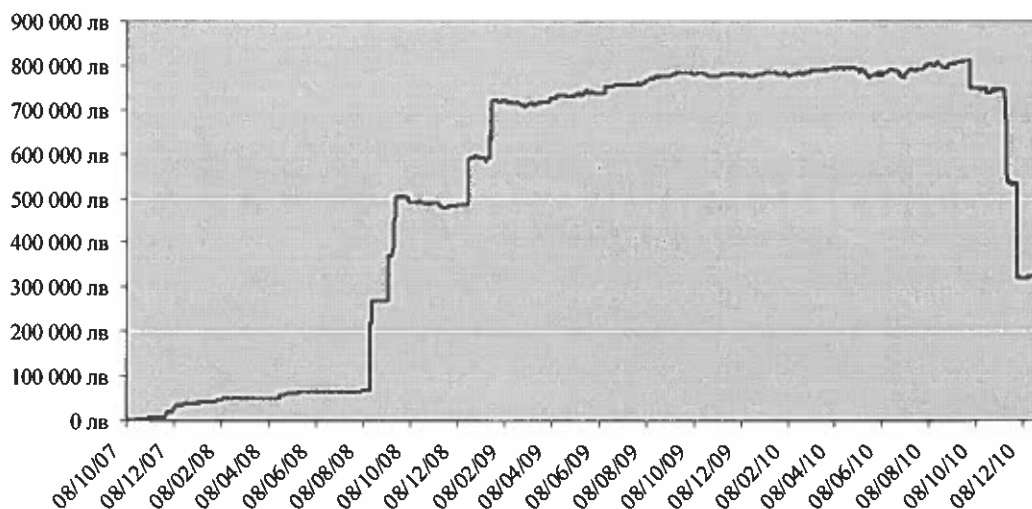


4) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „б“: Нетна стойност на активите на един дял

На 31.03.2010 г. изчислената нетна стойност на активите на един дял е в размер на 20.5041. Към 31.06.2010 г. нетната стойност на активите на един дял е 20.2724. Към 30.09.2010 г. нетната стойност на активите на един дял е 21.0273. Към 31.12.2010 г. нетната стойност на активите на един дял е 20.8552 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 2008	Към 31 Декември 2009	Към 31 Декември 2010
Нетна стойност на активите	593 092	781 155	323 318
Нетна стойност на активите на един дял	18.9216	20.2797	20.8552

6) 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.



Асет Мениджмънт

Рисков актив

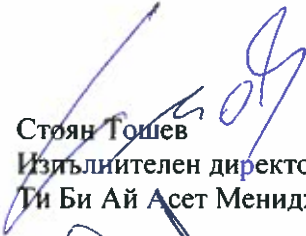
ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
валутно деноминиран актив	USD	642.1700	1.0000	\$642.17
валутно деноминиран актив	USD	230.0000	73.9487	\$17 008.20

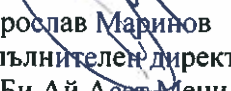
Обща рискова позиция	\$17 650.37
----------------------	-------------

Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 26 000.00	1.32949	\$34 566.74	OTC	България
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	-€ 13 000.00	1.33097	-\$17 302.61	OTC	България

Обща хеджираща позиция	\$17 264.13
------------------------	-------------


Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД


Мирослав Маринов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

