



# Асет Мениджмънт

## 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. Съгласно балансираната инвестиционна политика през периода са закупени корпоративни облигации.

Към 30.11.2011 г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище са разпределени в 8 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 30.11.2011 г. възлиза на 32.37%.

Към 30.11.2011 г. корпоративните облигации представляват 40.87% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище, а ипотечните облигации 9.48% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 11.05% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.11.2011 г. са 5.82% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с предварително платена такса към БФБ, както и вземания от лихвено и главнично плащане по емисия корпоративни облигации възлизат на 0.41% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.11.2011 г. е 0.67% на годишна база<sup>1</sup>, доходността от началото на годината е -1.40%, а доходността за последните 12 месеца към 30.11.2011г. е -1.17%.

### 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

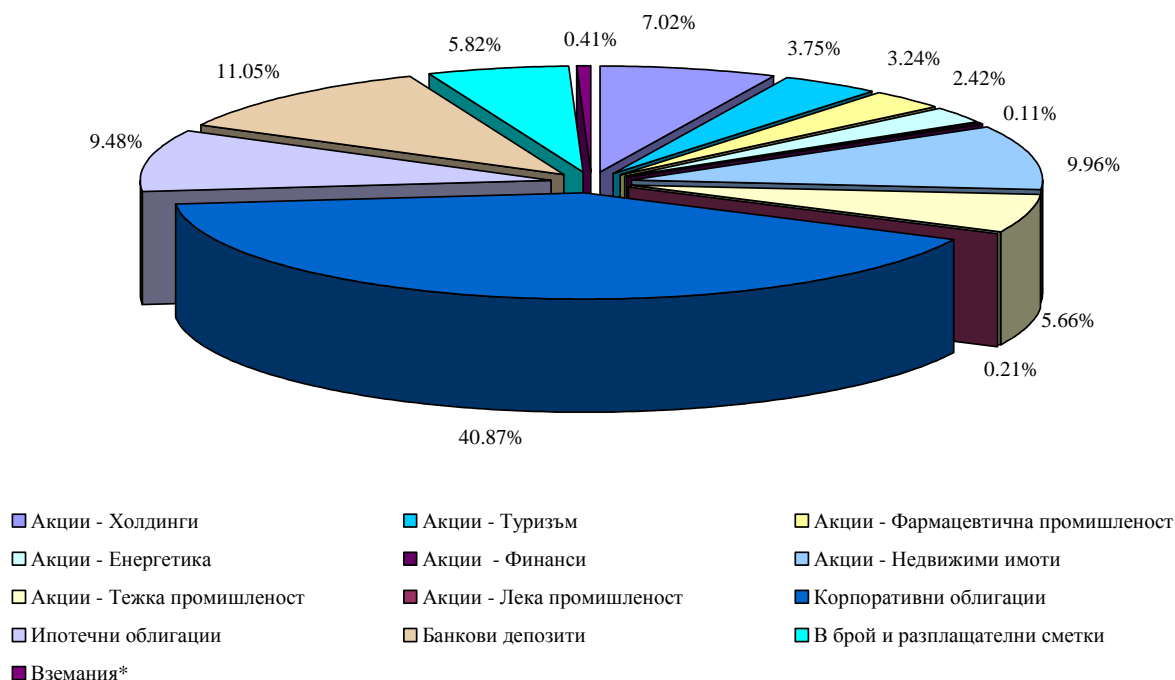
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище към 30.11.2011г. е представена в следната таблица и графика.

<sup>1</sup> Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

Структура на портфейла на ДФ "Ти Би Ай Съкровище" към 30/11/2011		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	7 502	7.02%
Акции - Туризм	4 012	3.75%
Акции - Фармацевтична промишленост	3 464	3.24%
Акции - Енергетика	2 583	2.42%
Акции - Финанси	114	0.11%
Акции - Недвижими имоти	10 646	9.96%
Акции - Тежка промишленост	6 052	5.66%
Акции - Лека промишленост	227	0.21%
Корпоративни облигации	43 704	40.87%
Ипотечни облигации	10 132	9.48%
Банкови депозити	11 815	11.05%
В брой и разплащателни сметки	6 227	5.82%
Вземания*	448	0.41%
<b>Общо активи</b>	<b>106 924</b>	<b>100.00%</b>

\* 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 30/11/2011





# Асет Мениджмънт

- 2) Данни по чл. 72, ал. 2, т. 2 от Наредба № 44: 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 30.11.2011 г. Фондът не притежава активи, деноминирани във валута , различна от лева и евро, и поради тази причина няма сключени хеджиращи сделки.

Мирослав Маринов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД