

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 няма закупени или продадени облигации и акции.

Към 29.02.2012 г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище са разпределени в 7 икономически сектора. Общият дял на тези акции в активите на Фонда към 29.02.2012 г. възлиза на 31.43%.

Към 29.02.2012 г. корпоративните облигации представляват 39.68% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище, а ипотечните облигации 9.31% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 11.15% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 29.02.2012 г. са 8.02% от стойността на портфейла.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисия корпоративни облигации възлизат на 0.41% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.02.2012 г. е 0.59% на годишна база*, доходността от началото на годината е минус 0.54%, а доходността за последните 12 месеца към 29.02.2012г. е минус 6.61%.

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

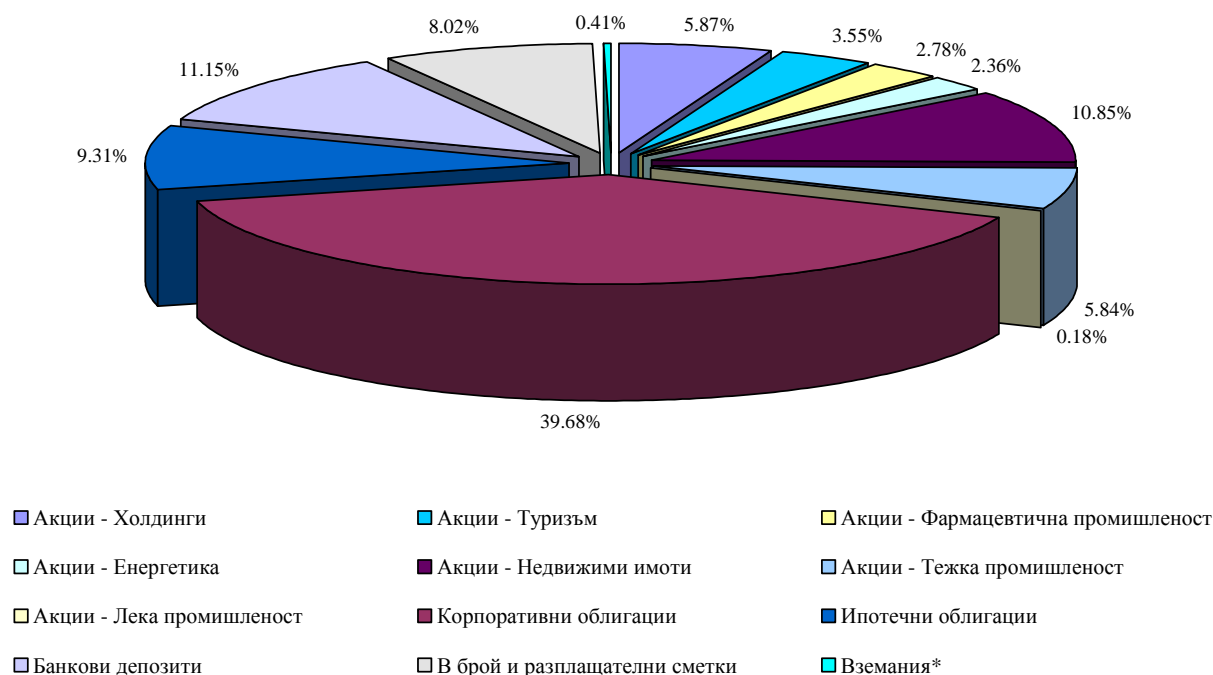
* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище към 29.02.2012г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ "Ти Би Ай Съкровище" към 29/02/2012		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	6 269	5.87%
Акции - Туризм	3 796	3.55%
Акции - Фармацевтична промишленост	2 974	2.78%
Акции - Енергетика	2 520	2.36%
Акции - Недвижими имоти	11 599	10.85%
Акции - Тежка промишленост	6 245	5.84%
Акции - Лека промишленост	193	0.18%
Корпоративни облигации	42 409	39.68%
Ипотечни облигации	9 947	9.31%
Банкови депозити	11 919	11.15%
В брой и разплащателни сметки	8 575	8.02%
Вземания*	432	0.41%
Общо активи	106 878	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 29/02/2012



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 29.02.2012 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