

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 31.08.2012 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 31.08.2012 г. възлиза на 31.31%.

Към 31.08.2012 г. корпоративните облигации представляват 32.19% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище, а ипотечните облигации 9.74% от стойността на активите.

Банковите депозити съставляват 11.93% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 31.08.2012 г. са 9.60% от стойността на портфейла.

Вземанията от начислени дивиденди, лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации възлизат на 5.23% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.08.2012 г. е 1.20% на годишна база*, доходността от началото на годината е 2.79%, а доходността за последните 12 месеца към 31.08.2012г. е 0.74%.

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

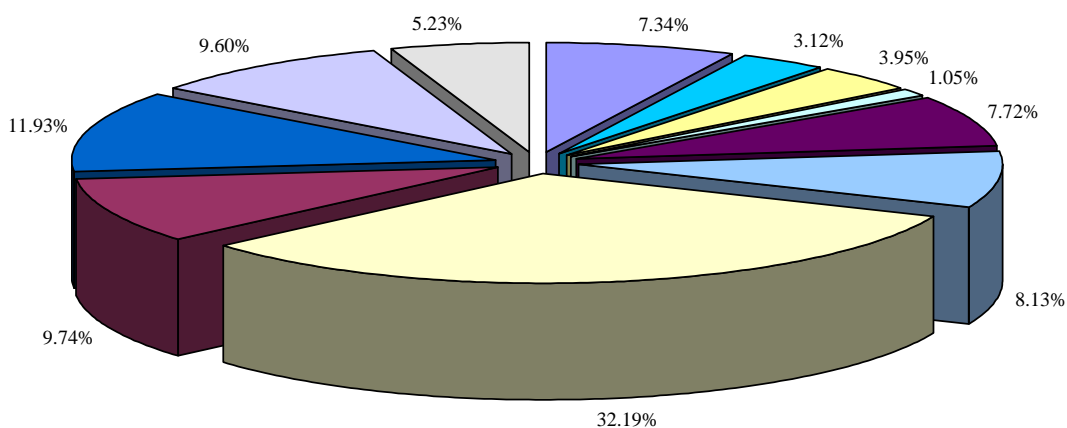
* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище към 31.08.2012г. е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ "Ти Би Ай Съкровище" към 31/08/2012		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Акции - Холдинги	7 465	7.34%
Акции - Туризм	3 173	3.12%
Акции - Фармацевтична промишленост	4 011	3.95%
Акции - Енергетика	1 070	1.05%
Акции - Недвижими имоти	7 848	7.72%
Акции - Тежка промишленост	8 266	8.13%
Корпоративни облигации	32 727	32.19%
Ипотечни облигации	9 900	9.74%
Банкови депозити	12 134	11.93%
В брой и разплащателни сметки	9 755	9.60%
Вземания*	5 318	5.23%
Общо активи	101 667	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 31/08/2012



- Акции - Холдинги
- Акции - Туризм
- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Енергетика
- Акции - Недвижими имоти
- Акции - Тежка промишленост
- Корпоративни облигации
- Ипотечни облигации
- Банкови депозити
- В брой и разплащателни сметки
- Вземания*

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 31.08.2012 г. Фондът не притежава деривативни финансови инструменти в портфейла си.

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД