



**ИНФОРМАЦИЯ,
СЪГЛАСНО ЧЛ. 48 ОТНАРЕДБА № 25 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ
ДЕЙНОСТТА НА ИНВЕСТИЦИОННИТЕ ДРУЖЕСТВА И ДОГОВОРНИ
ФОНДОВЕ**

ДФ Ти Би Ай Съкровище

Договорен фонд Ти Би Ай Съкровище стартира публичното предлагане на ценни книжа на 8 октомври 2007 г.

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 и стратегия на Ти Би Ай Съкровище, през периода от началото на публичното предлагане до 29.10.2010 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 29.10.2010 г. корпоративните облигации представляват 39.13% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище. Ипотечните облигации представляват 4.59% от общите активи на Фонда, а общинските облигации – 4.36% от активите на Фонда.

Към 29.10.2010 г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 18.40% от общите активи на фонда. Чуждестранните инвестиции са 6.61% от активите на Фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 11.11% от портфейла на Ти Би Ай Съкровище.

Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 15.62% от активите на Фонда към 29.10.2010 г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.10.2010 г. е 1.46%¹, доходността за последните 12 месеца към 29.10.2010г. е 3.82%, а доходността от началото на годината е 3.11%.

I. Данни по чл. 48, ал. 3 от Наредба № 25

1) Данни по чл. 48, ал. 3 т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти

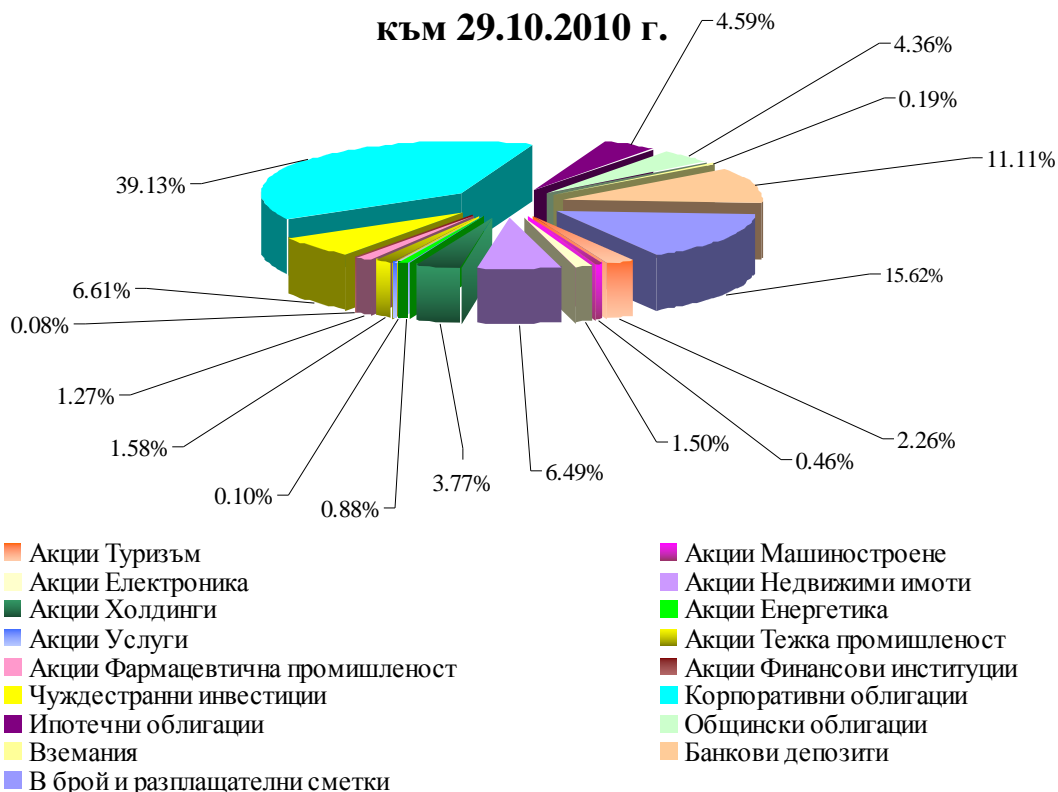
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище в края на периода е представена в следната таблица:

¹ 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 29.10.2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
Акции Туризъм	16 853	2.26%
Акции Машиностроене	3 456	0.46%
Акции Електроника	11 241	1.50%
Акции Недвижими имоти	48 517	6.49%
Акции Холдинги	28 161	3.77%
Акции Енергетика	6 595	0.88%
Акции Услуги	754	0.10%
Акции Тежка промишленост	11 815	1.58%
Акции Фармацевтична промишленост	9 464	1.27%
Акции Финансови институции	569	0.08%
Чуждестранни инвестиции	49 403	6.61%
Корпоративни облигации	292 324	39.13%
Ипотечни облигации	34 255	4.59%
Общински облигации	32 545	4.36%
Вземания	1 442	0.19%
Банкови депозити	83 008	11.11%
В брой и разплащателни сметки	116 654	15.62%
Общо активи	747 055	100.00%

* Вземания във връзка с предварително платени такси за БФБ, ЦД, КФН, лихвено плащане и плащане на главница.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Съкровище към 29.10.2010 г.





2) Данни по чл. 48, ал. 3, т. 2 от Наредба № 25

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
валутно деноминиран актив	USD	28 472.2600	1.0000	\$28 472.26
валутно деноминиран актив	USD	230.0000	75.5442	\$17 375.17
валутно деноминиран актив	USD	390.0000	45.1959	\$17 626.40

Обща рискова позиция	\$63 473.83
-----------------------------	-------------

Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 48 000.00	1.39671	\$67 042.08	OTC	България

Обща хеджираща позиция	\$67 042.08
-------------------------------	-------------

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД