

---

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

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 30.07.2010 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 30.07.2010 г. корпоративните облигации представляват 42.85% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище. Ипотечните облигации представляват 4.27% от общите активи на Фонда, а общинските облигации – 4.20% от активите на Фонда.

Към 30.07.2010 г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 15.25% от общите активи на фонда. Чуждестранните инвестиции са 13.40% от активите на Фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 10.26% от портфейла на Ти Би Ай Съкровище.

Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 9.17% от активите на Фонда към 30.07.2010 г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.07.2010 г. е 0.94%\*, доходността за последните 12 месеца към 30.07.2010г. е 4.50%, а доходността от началото на годината е 1.25%.

## **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:

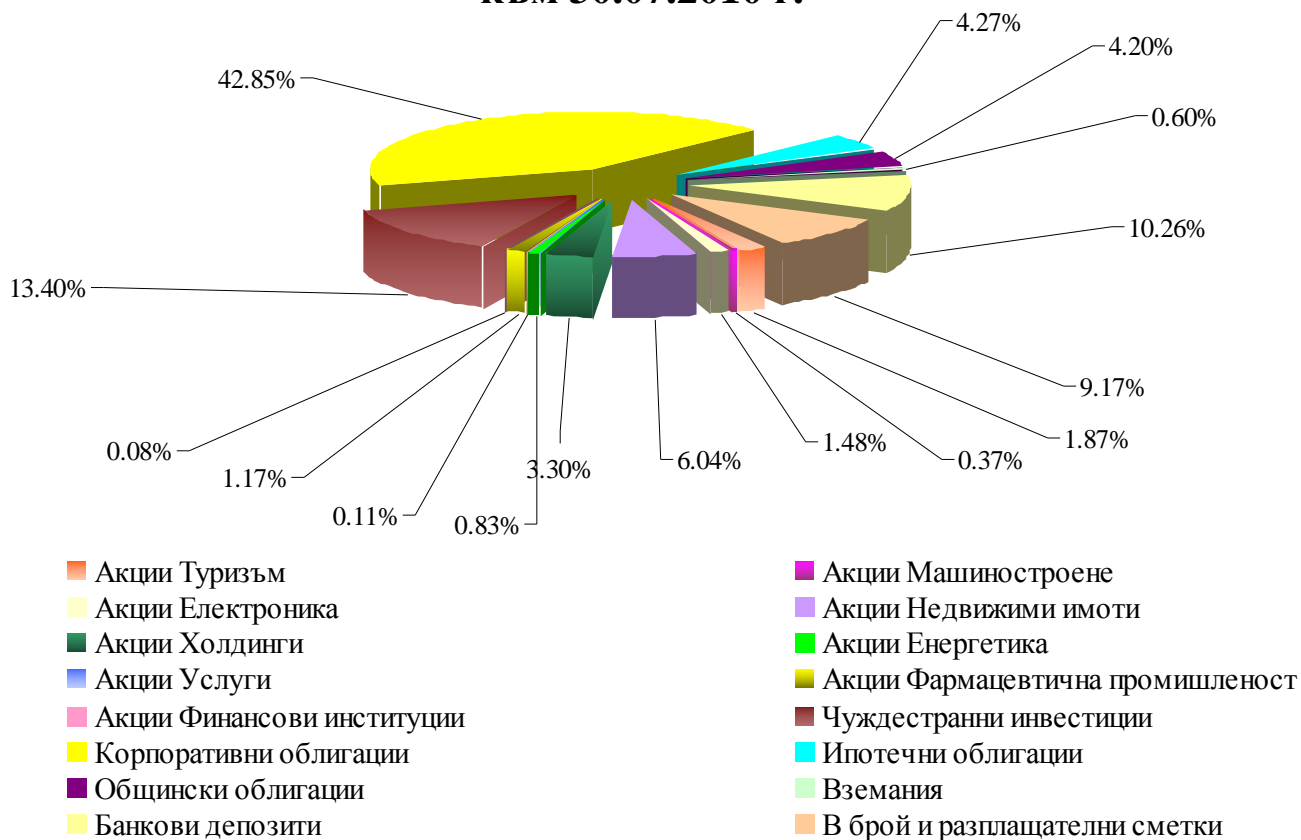
---

\* 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 30.07.2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
Акции Туризм	14 903	1.87%
Акции Машиностроене	2 918	0.37%
Акции Електроника	11 788	1.48%
Акции Недвижими имоти	48 010	6.04%
Акции Холдинги	26 270	3.30%
Акции Енергетика	6 623	0.83%
Акции Услуги	858	0.11%
Акции Фармацевтична промишленост	9 316	1.17%
Акции Финансови институции	609	0.08%
Чуждестранни инвестиции	106 567	13.40%
Корпоративни облигации	340 761	42.85%
Ипотечни облигации	33 924	4.27%
Общински облигации	33 440	4.20%
Вземания	4 803	0.60%
Банкови депозити	81 565	10.26%
В брой и разплащателни сметки	72 923	9.17%
<b>Общо активи</b>	<b>795 277</b>	<b>100.00%</b>

\* Вземания във връзка с предварително платени такси за БФБ, ЦД, хеджиране на валутни позиции и плащане на дивиденди.

### Разпределение на активите на Ти Би Ай Съкровище към 30.07.2010 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	230.0000	69.8515	\$16 065.85
валутно деноминиран актив	USD	390.0000	41.0298	\$16 001.62
валутно деноминиран актив	USD	700.0000	36.7700	\$25 739.00

<b>Обща рискова позиция</b>	<b>\$57 806.47</b>
-----------------------------	--------------------

**Дериватен инструмент**

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 48 000.00	1.25688	\$60 330.24	OTC	България

<b>Обща хеджираща позиция</b>	<b>\$60 330.24</b>
-------------------------------	--------------------

Стоян Тошев  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД