



**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 30.11.2010 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 30.11.2010 г. корпоративните облигации представляват 26.95% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище, а ипотечните облигации представляват 5.97% от общите активи на Фонда.

Към 30.11.2010 г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 21.55% от общите активи на фонда. Чуждестранните инвестиции са 12.10% от активите на Фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 8.66% от портфейла на Ти Би Ай Съкровище.

Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 24.72% от активите на Фонда към 30.11.2010 г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.11.2010 г. е 1.26%¹, доходността за последните 12 месеца към 30.11.2010г. е 2.76%, а доходността от началото на годината е 2.59%.

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

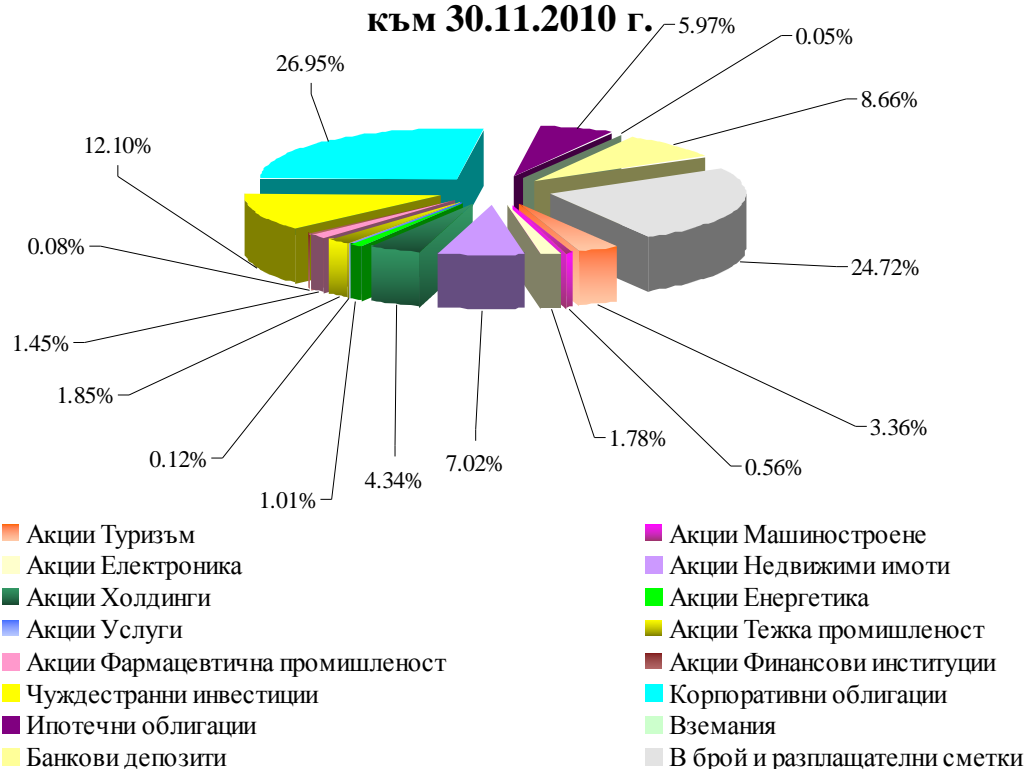
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище в края на периода е представена в следната таблица:

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 30.11.2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
Акции Туризъм	21 668	3.36%
Акции Машиностроене	3 593	0.56%
Акции Електроника	11 453	1.78%
Акции Недвижими имоти	45 285	7.02%
Акции Холдинги	27 992	4.34%
Акции Енергетика	6 532	1.01%
Акции Услуги	744	0.12%
Акции Тежка промишленост	11 912	1.85%
Акции Фармацевтична промишленост	9 330	1.45%
Акции Финансови институции	527	0.08%
Чуждестранни инвестиции	78 068	12.10%
Корпоративни облигации	173 844	26.95%
Ипотечни облигации	38 528	5.97%
Вземания	310	0.05%
Банкови депозити	55 843	8.66%
В брой и разплащателни сметки	159 494	24.72%
Общо активи	645 121	100.00%

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

Разпределение на активите на Ти Би Ай Съкровище към 30.11.2010 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	29 601.4600	1.0000	\$29 601.46
валутно деноминиран актив	USD	230.0000	73.2427	\$16 845.82
валутно деноминиран актив	USD	390.0000	43.9481	\$17 139.76

Обща рискова позиция	\$63 587.04
----------------------	-------------

Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 48 000.00	1.37878	\$66 181.44	OTC	България

Обща хеджираща позиция	\$66 181.44
------------------------	-------------

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД