
**ИНФОРМАЦИЯ,
СЪГЛАСНО ЧЛ. 48 ОТНАРЕДБА № 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 30.06.2010 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 30.06.2010 г. корпоративните облигации представляват 43.34% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище. Ипотечните облигации представляват 4.25% от общите активи на Фонда, а общинските облигации – 4.39% от активите на Фонда.

Към 30.06.2010 г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 15.58% от общите активи на фонда. Чуждестранните инвестиции са 18.12% от активите на Фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 10.33% от портфейла на Ти Би Ай Съкровище.

Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 3.59% от активите на Фонда към 30.06.2010 г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.06.2010 г. е 0.50%*, доходността за последните 12 месеца към 30.06.2010г. е 3.33%, а доходността от началото на годината е -0.04%.

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

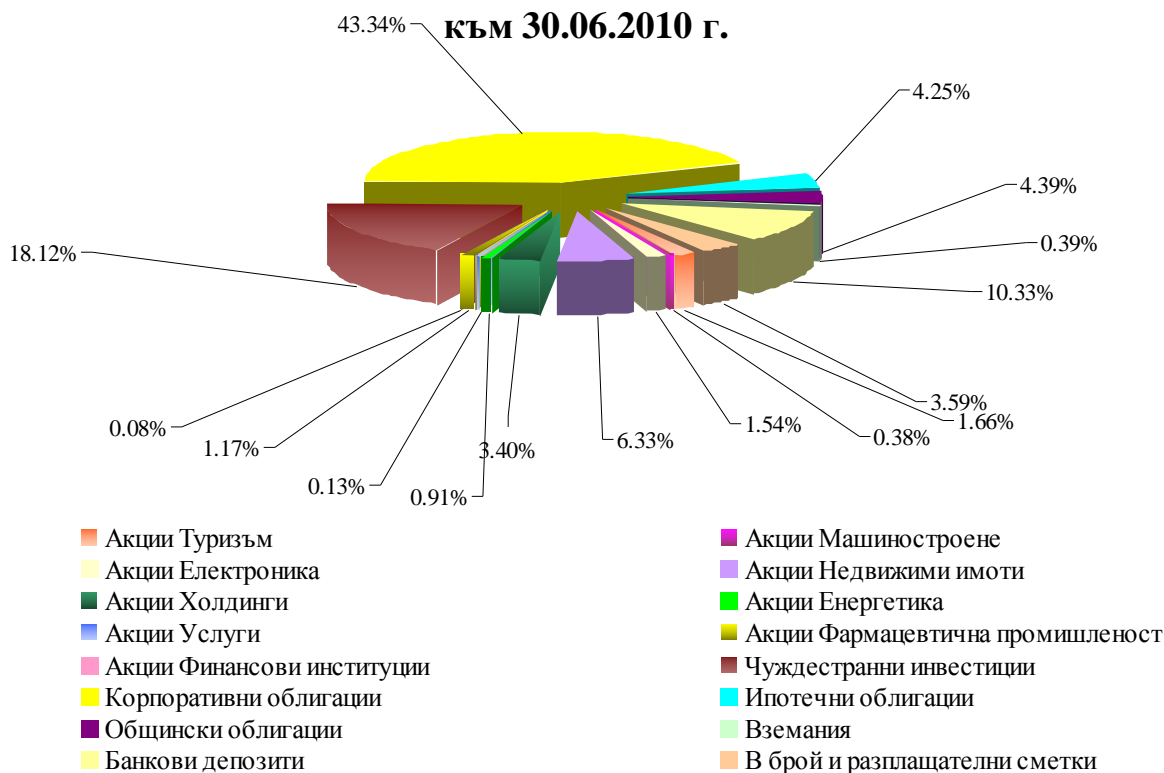
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище в края на периода е представена в следната таблица:

* 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 30.06.2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
Акции Туризмъ	13 020	1.66%
Акции Машиностроене	2 964	0.38%
Акции Електроника	12 103	1.54%
Акции Недвижими имоти	49 640	6.33%
Акции Холдинги	26 656	3.40%
Акции Енергетика	7 122	0.91%
Акции Услуги	992	0.13%
Акции Фармацевтична промишленост	9 181	1.17%
Акции Финансови институции	616	0.08%
Чуждестранни инвестиции	142 234	18.12%
Корпоративни облигации	340 083	43.34%
Ипотечни облигации	33 373	4.25%
Общински облигации	34 429	4.39%
Вземания	3 068	0.39%
Банкови депозити	81 093	10.33%
В брой и разплащателни сметки	28 175	3.59%
Общо активи	784 750	100.00%

* Вземания във връзка с предварително платени такси за БФБ, хеджиране на валутни позиции и лихвено плащане

Разпределение на активите на Ти Би Ай Съкровище към 30.06.2010 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	62.8660	\$14 459.18		
валутно деноминиран актив	USD	390.0000	40.0627	\$15 624.45		
валутно деноминиран актив	USD	700.0000	32.9200	\$23 044.00		
Обща рискова позиция				\$53 127.63		
Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 48 000.00	1.20292	\$57 740.16	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$57 740.16		

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД