

**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 31.08.2010 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 31.08.2010 г. корпоративните облигации представляват 37.54% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище. Ипотечните облигации представляват 4.28% от общите активи на Фонда, а общинските облигации – 4.20% от активите на Фонда.

Към 31.08.2010 г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 17.25% от общите активи на фонда. Чуждестранните инвестиции са 16.44% от активите на Фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 10.28% от портфейла на Ти Би Ай Съкровище.

Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 9.74% от активите на Фонда към 31.08.2010 г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.08.2010 г. е 0.92%\*, доходността за последните 12 месеца към 31.08.2010г. е 2.38%, а доходността от началото на годината е 1.27%.

## **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**

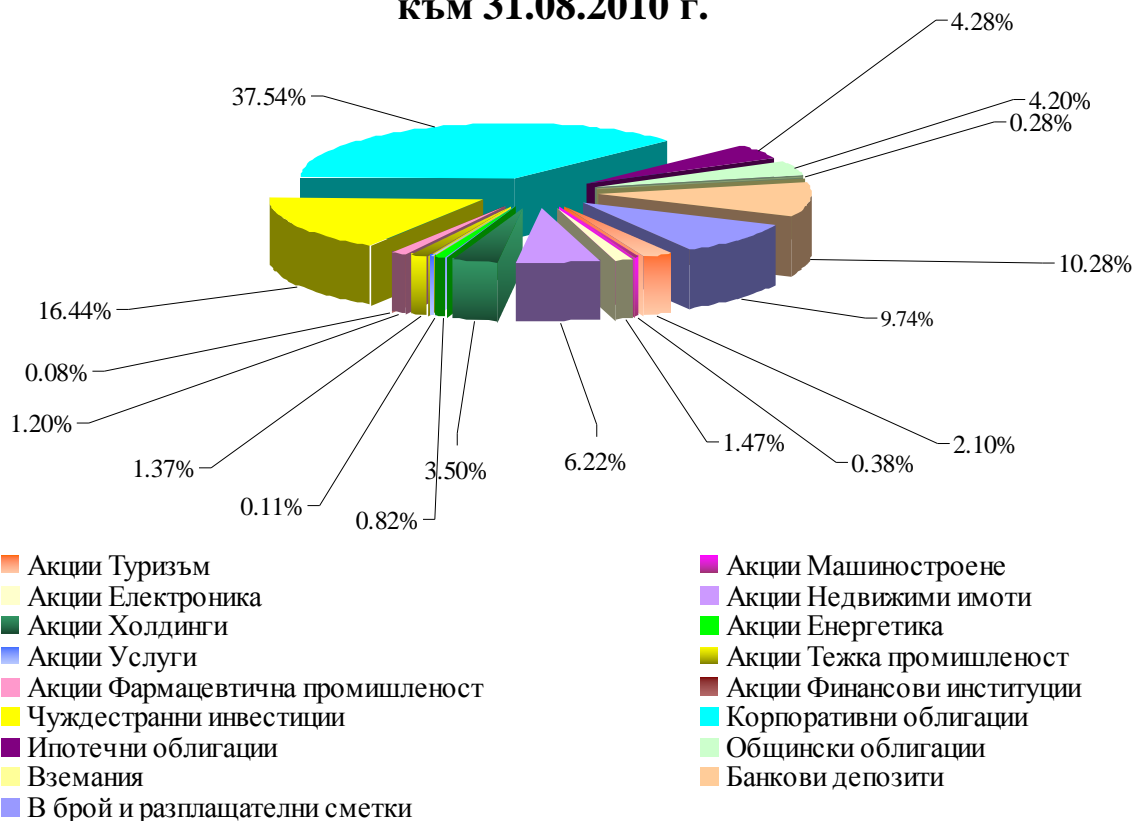
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище в края на периода е представена в следната таблица:

\* 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 31.08.2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
Акции Туризмъ	16 812	2.10%
Акции Машиностроене	3 009	0.38%
Акции Електроника	11 781	1.47%
Акции Недвижими имоти	49 656	6.22%
Акции Холдинги	27 949	3.50%
Акции Енергетика	6 566	0.82%
Акции Услуги	858	0.11%
Акции Тежка промишленост	10 946	1.37%
Акции Фармацевтична промишленост	9 596	1.20%
Акции Финансови институции	643	0.08%
Чуждестранни инвестиции	131 282	16.44%
Корпоративни облигации	299 841	37.54%
Ипотечни облигации	34 157	4.28%
Общински облигации	33 570	4.20%
Вземания	2 200	0.28%
Банкови депозити	82 070	10.28%
В брой и разплащателни сметки	77 774	9.74%
<b>Общо активи</b>	<b>798 710</b>	<b>100.00%</b>

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

### Разпределение на активите на Ти Би Ай Съкровище към 31.08.2010 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	66.9548	\$15 399.60
валутно деноминиран актив	USD	390.0000	39.7894	\$15 517.87
валутно деноминиран актив	USD	700.0000	33.3700	\$23 359.00

<b>Обща рискова позиция</b>	<b>\$54 276.47</b>
-----------------------------	--------------------

**Дериватен инструмент**

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 48 000.00	1.30749	\$62 759.52	OTC	България

<b>Обща хеджираща позиция</b>	<b>\$62 759.52</b>
-------------------------------	--------------------

Стоян Тошев  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД