



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 30.12.2010 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 30.12.2010 г. корпоративните облигации представляват 22.69% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище, а ипотечните облигации представляват 7.87% от общите активи на Фонда.

Към 30.12.2010 г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 24.54% от общите активи на фонда. Чуждестранните инвестиции са 15.82% от активите на Фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 17.31% от портфейла на Ти Би Ай Съкровище.

Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 10.78% от активите на Фонда към 30.12.2010 г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.12.2010 г. е 1.30%¹, доходността за последните 12 месеца към 30.12.2010г. е 2.84%, а доходността от началото на годината е 2.84%.

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

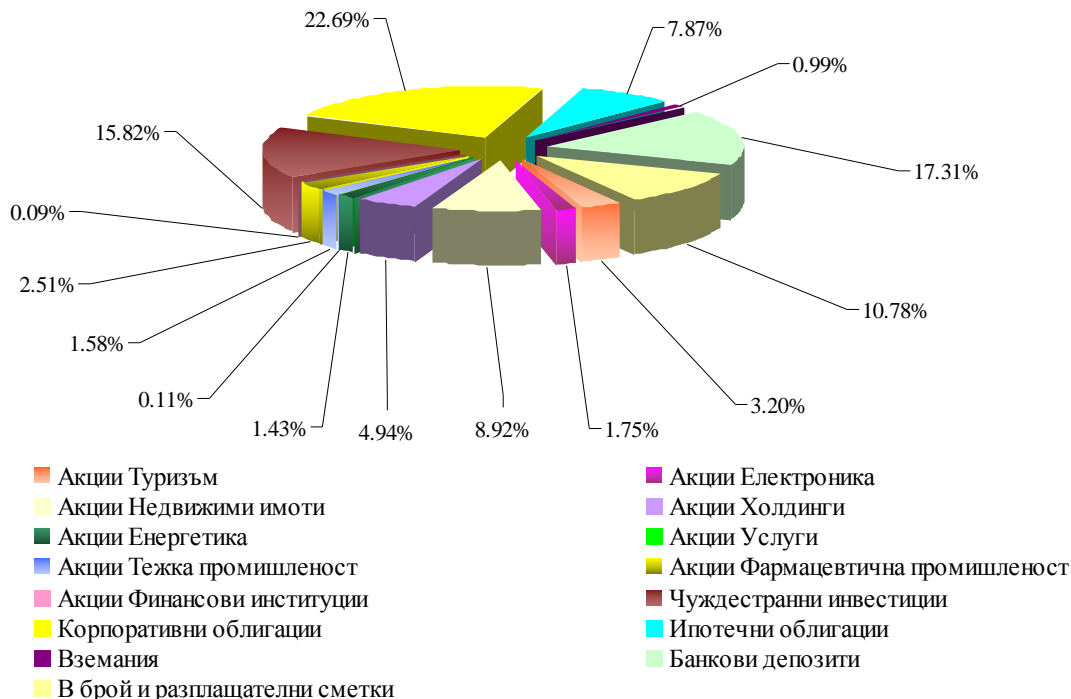
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище в края на периода е представена в следната таблица:

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 30.12.2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
Акции Туризъм	10 382	3.20%
Акции Електроника	5 688	1.75%
Акции Недвижими имоти	28 948	8.92%
Акции Холдинги	16 047	4.94%
Акции Енергетика	4 655	1.43%
Акции Услуги	355	0.11%
Акции Тежка промишленост	5 134	1.58%
Акции Фармацевтична промишленост	8 137	2.51%
Акции Финансови институции	297	0.09%
Чуждестранни инвестиции	51 355	15.82%
Корпоративни облигации	73 623	22.69%
Ипотечни облигации	25 540	7.87%
Вземания	3 223	0.99%
Банкови депозити	56 176	17.31%
В брой и разплащателни сметки	34 972	10.78%
Общо активи	324 533	100.00%

* Вземания във връзка с дивиденди и лихвено плащане.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Съкровище към 30.12.2010 г.



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



Асет Мениджмънт

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	642.1700	1.0000	\$642.17
валутно деноминиран актив	USD	230.0000	73.9487	\$17 008.20

Обща рискова позиция	\$17 650.37
-----------------------------	--------------------

Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 26 000.00	1.32949	\$34 566.74	OTC	България
форуърд продава EUR/USD	EUR/USD	-€ 13 000.00	1.33097	-\$17 302.61	OTC	България

Обща хеджираща позиция	\$17 264.13
-------------------------------	--------------------

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Мирослав Маринов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД