



**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 30.09.2010 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 30.09.2010 г. корпоративните облигации представляват 35.86% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище. Ипотечните облигации представляват 4.18% от общите активи на Фонда, а общинските облигации – 4.19% от активите на Фонда.

Към 30.09.2010 г. договорният фонд притежава акции на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 17.34% от общите активи на фонда. Чуждестранните инвестиции са 13.31% от активите на Фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 22.42% от портфейла на Ти Би Ай Съкровище.

Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 1.70% от активите на Фонда към 30.09.2010 г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.09.2010 г. е 1.69%¹, доходността за последните 12 месеца към 30.09.2010г. е 3.59%, а доходността от началото на годината е 3.69%.

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.

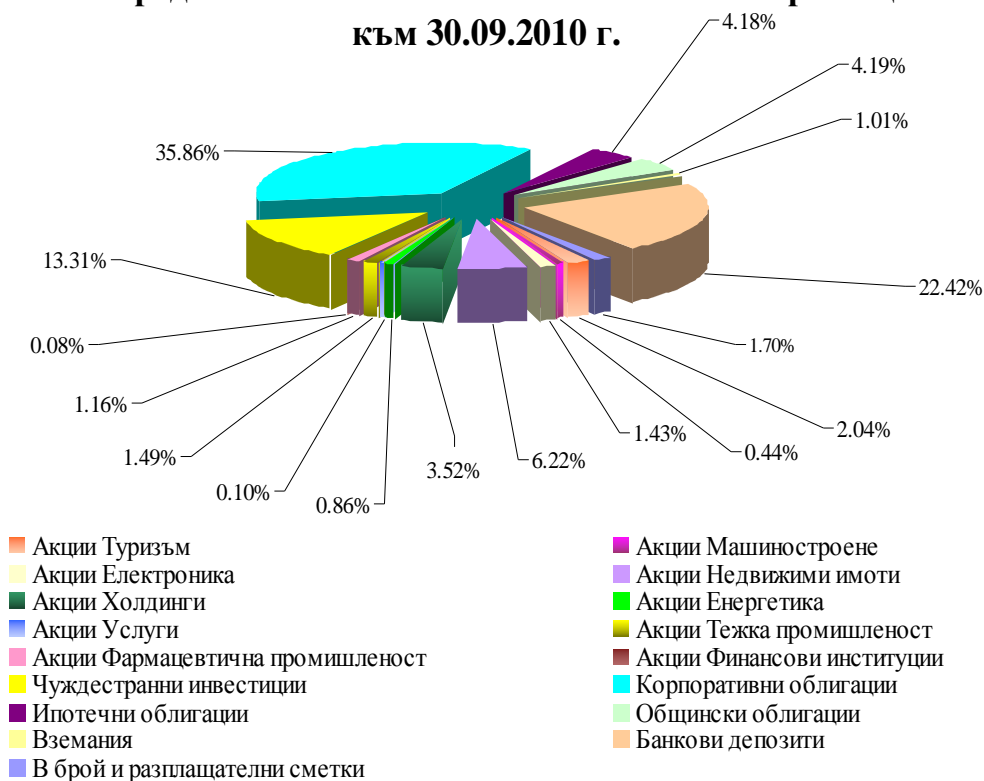


Асет Мениджмънт

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище към 30.09.2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
Акции Туризъм	16 634	2.04%
Акции Машиностроене	3 585	0.44%
Акции Електроника	11 681	1.43%
Акции Недвижими имоти	50 699	6.22%
Акции Холдинги	28 693	3.52%
Акции Енергетика	6 993	0.86%
Акции Услуги	804	0.10%
Акции Тежка промишленост	12 109	1.49%
Акции Фармацевтична промишленост	9 452	1.16%
Акции Финансови институции	627	0.08%
Чуждестранни инвестиции	108 457	13.31%
Корпоративни облигации	292 244	35.86%
Ипотечни облигации	34 043	4.18%
Общински облигации	34 123	4.19%
Вземания	8 224	1.01%
Банкови депозити	182 706	22.42%
В брой и разплащателни сметки	13 847	1.70%
Общо активи	814 921	100.00%

* Вземания във връзка с предварително платени такси за БФБ, ЦД, КФН, плащане на дивиденди и лихвено плащане, както и вземания от хеджиране.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Съкровище към 30.09.2010 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	74.6299	\$17 164.88
валутно деноминиран актив	USD	390.0000	42.8949	\$16 729.01
валутно деноминиран актив	USD	700.0000	39.6200	\$27 734.00

Обща рискова позиция	\$61 627.89
-----------------------------	-------------

Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 48 000.00	1.26801	\$60 864.48	OTC	България

Обща хеджираща позиция	\$60 864.48
-------------------------------	-------------

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД