
**ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО
ЧЛ. 48 и ЧЛ. 73Г ОТ НАРЕДБА № 25 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА
ИНВЕСТИЦИОННИТЕ ДРУЖЕСТВА И ДОГОВОРНИ ФОНДОВЕ ЗА ДОГОВОРЕН
ФОНД „ТИ БИ АЙ СЪКРОВИЩЕ”**

I. Данни по чл. 73г, ал. 1, т. 6 от Наредба № 25

1) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б „г”: Промени в структурата на портфейла през отчетния период

Съгласно балансираната инвестиционна политика и стратегия на Фонда за инвестиране на до 60% от активите в дългови ценни книжа и до 60% в акции, както и до 20% от активите в дялове на колективни инвестиционни схеми, през периода са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и са закупени и продадени акции на публични дружества на БФБ – София АД.

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%¹, доходността за последните 12 месеца към 30.06.2010г. е 3.33%, а доходността от началото на годината е -0.04%.

2) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „а” и „д”: Промени в състоянието на активите в рамките на отчетния период

Долната таблица представя приходите на Фонда към 30.06.2010 г. Приходите са в размер на 212 419 лева, включващи преценка от операции с финансови активи, приходи от лихви, приходи от положителни валутни курсови разлики и други приходи

¹ Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

Приходи	Стойност в лева	Стойност в лева	Стойност в лева
	30/12/09	31/03/10	30/06/10
Приходи от лихви	40 917	9 552	18 443
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	273 609	63 455	152 001
Положителни курсови разлики	3 805	8 775	41 081
Други финансови приходи	3259	152	894
Общ приходи:	321 590	81 934	212 419

Разходите на Фонда за отчетния период са представени в таблицата по-долу:

Разходи	Стойност в лева	Стойност в лева	Стойност в лева
	30/12/09	31/03/10	30/06/10
Разходи от операции с финансови активи	243 745	59 545	161 717
Отрицателни курсови разлики	3 968	8 570	40 143
Разходи за външни услуги	17 294	4 735	9 528
Други финансови разходи	2 685	416	1 306
Общо разходи:	267 692	73 266	212 694

Общият размер на разходите на фонда към 30.06.2010 г. е 212 694 лева, които включват 161 717 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 40 143 лв. разходи от отрицателни курсови разлики.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 30 юни 2010 – 7 018 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.89%

б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество

- към 30 юни 2010 – 260 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.03%

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 30 юни 2010 – 1 815 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.23%

г) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие

- към 30 юни 2010 – 210 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.03%

д) Други разходи

- към 30 юни 2010 – 1 532 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.19%

- Други разходи по финансови операции: 1 046 лв.
- Външни услуги (КФН, ЦД и БФБ): 486 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 10 834 лв. към месец юни. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 1.38%.

За периода са записани 36.4156 дяла и са изкупени обратно 36.2791 дяла. НСА на фонда към 30.06.2010 г. е 783 073.45лв. Броят дялове към края на отчетния период е 38 627.5107.

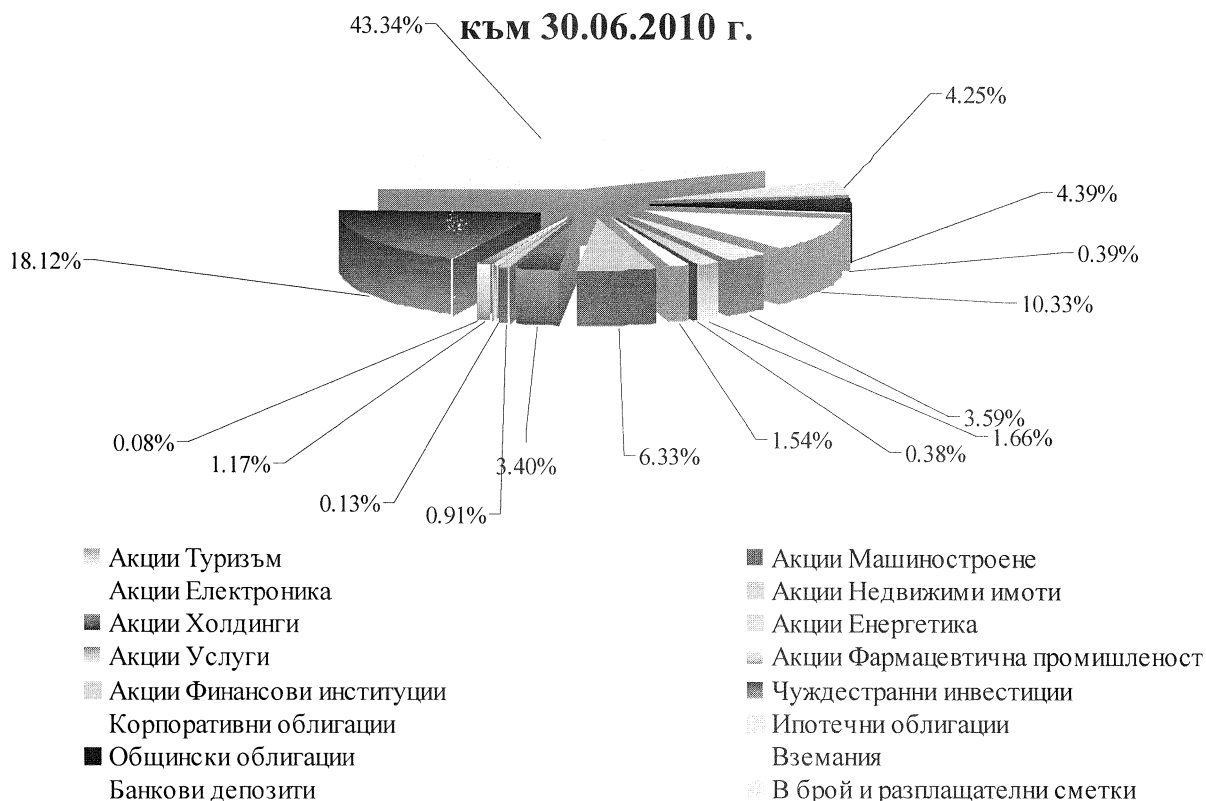
3) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „в”: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище в края на периода е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Съкровище към 30.06.2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
Акции Туризм	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

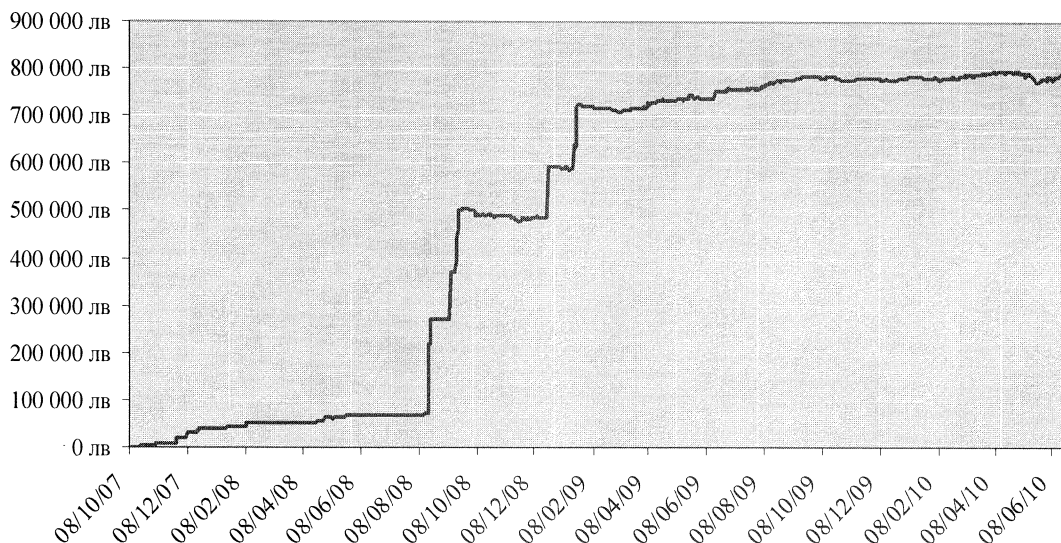


4) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „б“: Нетна стойност на активите на един дял

Към 30.06.2010 г. нетната стойност на активите на един дял е 20.2724лв.

Изменението на нетната стойност на активите на Фонда е представено на следващата графика.

Нетна стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Съкровище



II. Данни по чл. 48, ал. 3, т. 2 от 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				\$33 127.63		
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