

**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 ХАРМОНИЯ”**

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 Ти Би Ай Хармония, през периода от началото на публичното предлагане до 31.03.2010 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 31.03.2010 г. корпоративните облигации представляват 33.37% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Хармония, а ипотечните облигации са 0.36% от стойността на активите.

Към 31.03.2010 г. Фондът притежава акции, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 34.50% от общите активи на фонда и чуждестранни инвестиции в размер на 8.31% от активите.

Делът на инвестициите в депозити е 10.61% от портфейла на ДФ Ти Би Ай Хармония, като 10% от тези средства са предоставени на краткосрочни депозити във връзка с ограниченията за ликвидност на Фонда.

Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 4.54% от активите на Фонда към 31.03.2010 г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.03.2010 г. е 4.41% на годишна база*, доходността за последните 12 месеца към 31.03.2010 г. е 16.64%, а доходността от началото на годината е -0.10%.

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 31.03.2010г. Приходите са в размер на 333 150 лева, включващи преценка от операции с финансови активи, приходи от лихви, положителни курсови разлики и други финансови приходи.

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



Приходи			
	30/09/2009	30/12/2009	31/03/2010
Приходи от лихви	79 666	101 035	19 003
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	2 131 864	2 469 104	289 313
Положителни курсови разлики от промяна на валутни курсове	68	11 703	24 645
Други финансови приходи	46 005	46 018	189
Общо приходи:	2 257 602	2 627 860	333 150

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

Разходи			
	30/09/2009	30/12/2009	31/03/2010
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	2 162 115	2 541 959	298 456
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	204	12 106	24 814
Разходи за външни услуги	37 897	49 801	11 294
Други разходи	4 131	7 236	895
Общо разходи:	2 204 347	2 611 102	335 459

Общият размер на разходите на фонда към 31.03.2010г. е 335 459 лева, които включват 298 456 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и отрицателни валутни курсови разлики в размер на 24 814 лева.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 31 март 2010 – 9 836 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.43%

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

- към 31 март 2010 – 387 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.02%

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 31 март 2010 – 600 лв.

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

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



- към 31 март 2010 – 600 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.03%

д) Други разходи

- към 31 март 2010 – 766 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.03%
- Други разходи по финансови операции: 508 лв.
- Външни услуги (КФН, БФБ, ЦД): 258 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 12 189 лв. към месец март. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 0.54%.

За периода са записани 407.1368 дяла и са обратно изкупени 3 345.2551 дяла. НСА на фонда към 30.12.2009г. е 2 289 253 лв., а към 31.03.2010г. е 2 251 755 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 187 334.9701.

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 Хармония в края на периода е представена в следната таблица и графика.

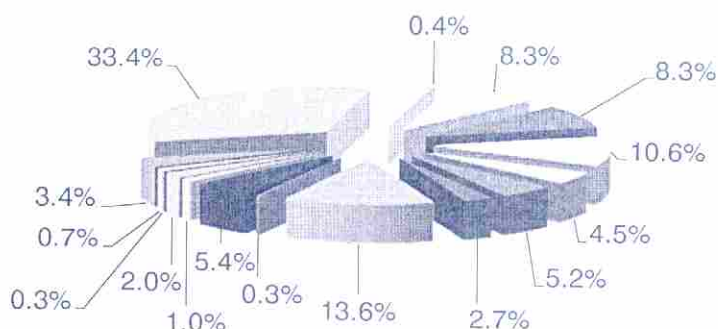
Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Хармония към 31/03/2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
Акции Холдинги	116 883	5.17%
Акции Туризъм	60 629	2.68%
Акции Недвижими имоти	306 304	13.56%
Акции Миннодобивна промишленост	7 483	0.33%
Акции Фармацевтична промишленост	121 294	5.37%
Акции Тютюнева промишленост	23 598	1.04%
Акции Енергетика	45 516	2.01%
Акции Финанси	5 813	0.26%
Акции Лека промишленост	15 131	0.67%
Акции Електроника	76 746	3.40%
Корпоративни облигации	753 776	33.37%
Ипотечни облигации	8 051	0.36%
Чуждестранни инвестиции	187 715	8.31%
Вземания	187 766	8.31%
Банкови депозити	239 747	10.61%
В брой и разплащателни сметки	102 447	4.54%



Общо активи	2 258 896	100.00%
--------------------	------------------	----------------

* Вземания във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации и авансово платена такса на БФБ и КФП.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Хармония към 31.03.2010 г.



■ Акции Холдинги	■ Акции Туризъм
■ Акции Недвижими имоти	■ Акции Миннодобивна промишленост
■ Акции Фармацевтична промишленост	■ Акции Тютюнева промишленост
■ Акции Енергетика	■ Акции Финанси
■ Акции Лека промишленост	■ Акции Електроника
■ Корпоративни облигации	■ Ипотечни облигации
■ Чуждестранни инвестиции	■ Вземания
■ Банкови депозити	■ В брой и разплащателни сметки

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

На 30.12.2009 г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 12.0314 лв. Към 31.03.2010 г. нетната стойност на активите на един дял е 12.0199 лв.

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



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	1938.6690	23.2469	\$45 068.04
Валутно деноминиран актив	USD	1000.0000	42.2800	\$42 280.00

Обща рискова позиция	\$87 348.04
-----------------------------	--------------------

Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 36 000.00	1.365120	\$49 144.32	OTC	България
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 28 000.00	1.353765	\$37 905.42	OTC	България

Обща хеджираща позиция	\$87 049.74
-------------------------------	--------------------

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

