

Информация по чл. 73д, т. 3 от Наредба № 25
за изискванията към дейността на инвестиционните дружества и договорните фондове
Договорен фонд “Райфайзен (България) Фонд Паричен Пазар”

а) Брой дялове в началото и края на отчетния период

В началото и края на отчетния период броят дялове в обръщение на Райфайзен (България) Фонд Паричен Пазар е, както следва:

Към 30.09.2009 г.: 13 589 793.1098 дяла

Към 30.12.2009 г.: 29 864 817.4876 дяла.

Период	Септември.09	Октомври .09	Ноември.09	Декември.09
Общ брой емитирани дялове	1 691 918.6586	0.0000	166 500.1665	16 926 510,3457
Общ брой обратно изкупени дялове	277 936.3715	62 859.5302	0.0000	755 126.6042
Брой дялове в обръщение	13 589 793.1098	13 526 933.5796	13 693 433.7461	29 864 817.4876

б) Нетна стойност на активите на един дял

Нетната стойност на активите на дял към 30.09.2009 г. е: 1.1874 лева.

Нетната стойност на активите на дял към 31.12.2009 г. е: 1.2094 лева.

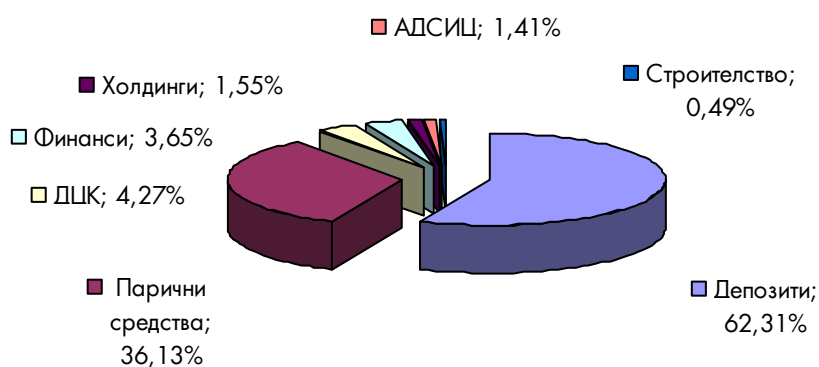
в) Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти, анализирани по най-подходящите икономически, географски или валутни показатели, съгласно политиката на договорния фонд с посочване на относителния им дял в нетните активи

1. Обем и структура на инвестициите в портфейла по отрасли като процент от общата нетна стойност на активите

Разпределението на активите в портфейла на фонда по отрасли е представено в таблицата по-долу, като отрасъл промишленост е по-широкоспектърен и обобщава различни подотрасли от леката и тежката промишленост.

Отрасъл	Стойност в лева	% от портфейла	% от НСА
Парични средства	22 505 462,31	56,75%	62,31%
Депозити	13 049 812,96	32,90%	36,13%
Държавен дълг	1 542 782,22	3,89%	4,27%
Финанси	1 317 032,78	3,32%	3,65%
Холдинги	559 904,63	1,41%	1,55%
АДСИЦ	508 439,22	1,28%	1,41%
Строителство	175 632,08	0,44%	0,49%
Общо	39 659 066,20	100,00%	109,81%

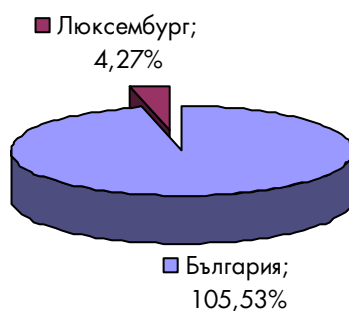
Разпределение на портфейла по отрасли (като % от НСА)



2. Обем и структура на инвестициите в портфейла по географско разпределение (държава, в която се търгува дружеството емитент) като процент от общата нетна стойност на активите

Държава	Равностойност в лева	% от портфейла	% от НСА
България	38 116 283,98	96,11%	105,53%
Люксембург	1 542 782,22	3,89%	4,27%
Общо	39 659 066,20	100,00%	109,81%

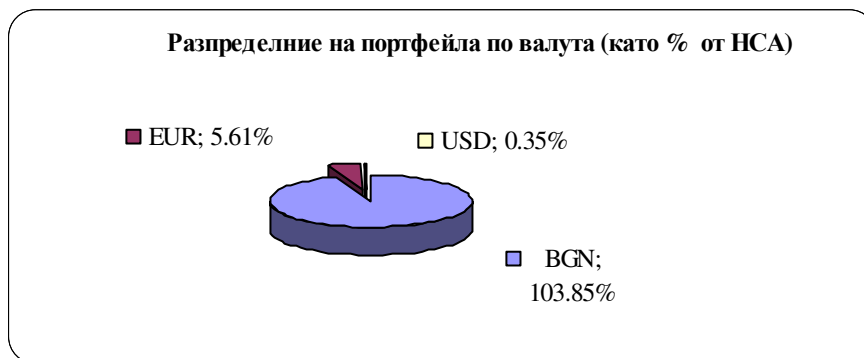
Разпределение на портфейла по държава, в която се търгува дружеството-емитент (като % от НСА)



3. Обем и структура на инвестициите в портфейла по валути като процент от общата нетна стойност на активите

Към 31.12.2009 г. инвестициите в портфейла на ДФ "Райфайзен (България) Фонд Паричен Пазар" представляват ДЦК, корпоративни облигации, депозити и парични средства по разплащателни сметки в лева и валута. В зависимост от валутата на инвестицията, те са разпределени в общата нетна стойност на активите на фонда, както следва:

Валута	Равностойност в лева	% от портфейла	% от НСА
BGN	37 508 507.20	94.58%	103.85%
EUR	2 025 885.29	5.11%	5.61%
USD	124 673.71	0.31%	0.35%
ОБЩО	39 659 066,20	100,00%	109.81%



Вземанията и задълженията на фонда са в лева и представляват съответно 0,00% и 9.81% от НСА на фонда. Разходите за бъдещи периоди са в размер на 0,00% от НСА.

г) Промени в структурата на портфейла, които са настъпили през отчетния период

Промените в структурата на портфейла на ДФ “Райфайзен (България) Фонд Паричен Пазар”, направени през отчетния период, изцяло отговарят на инвестиционната политика и рисковата насоченост, заложен в Проспекта на договорния фонд, както и на изискванията на съответните нормативни актове.

Активи	към 31.12.2009г.		към 30.09.2009г.	
	Стойност (лв.)	Дял (%)	Стойност (лв.)	Дял (%)
Депозити	22 505 462,31	56,75%	9 766 019.63	60.48%
Корпоративни облигации	2 561 008,71	6,46%	1 872 418.01	11.60%
ДЦК	1 542 782,22	3,99%	4 399 371.67	27.25%
Парични средства в разплащателни сметки в лева	13 049 812,96	32,90%	107 057.79	0.66%
Справедлива стойност на валутен форуърд			2 011.73	0.01%
Общо	39 659 066,20	100.00%	16 146 878.83	100.00%

д) Промени в състоянието на активите в рамките на отчетния период, включващи приходи от инвестиции, други приходи, разходи за управление, такса за обслужване на банката депозитар, други плащания и данъци, нетни приходи, разпределение на дохода и инвестиции на този доход, промени в капитала, нарастване или спад на инвестициите и всички други промени, които са се отразили в стойността на активите и пасивите.

Обща стойност на активите в началото и в края на отчетния период

Общата стойност на активите към 30.09.2009 г. е в размер на 16 147 189.22 лв.
Общата стойност на активите към 31.12.2009 г. е в размер на 39 659 066.20 лв.

Нетна стойност на активите в началото и в края на отчетния период

Нетната стойност на активите към 30.09.2009 г. е в размер на 16 137 065.68 лв.

Нетната стойност на активите към 31.12.2009 г. е в размер на 36 117 546.43 лв.

В таблиците по-долу са представени извършените разходи и приходи на фонда, нетно по тримесечия - за трето и четвърто тримесечие на 2009г. В последните колони е изчислено увеличението/намалението на съответните суми за четвъртото тримесечие на 2009г. спрямо третото тримесечие на 2009г., в стойностно и процентно изражение. Разходите за външни услуги са показани подробно.

Разходи	Стойност (лв.)	Стойност (лв.)	Изменение	
	за 3-то тримес.09г.	за 4-то тримес.09г.	в стойност	в %
Разходи от сделки с инвестиции	0	12	11	8150.00%
Разходи от преоценки на инвестиции	43 841	66 336	22 495	51.31%
Разходи за външни услуги	29 445	37 702	8 257	28.04%
Разходи от валутни операции	35 815	33 521	-2 295	-6.41%
Общо	109 102	137 571	28 469	26.09%

Приходи	Стойност (лв.)	Стойност (лв.)	Изменение	
	за 3-то тримес.09г.	за 4-то тримес.09г.	в стойност	в %
Приходи от лихви	262 366	302 376	40 010	15.25%
Приходи от сделки с инвестиции	2 935	8 802	5 867	199.90%
Приходи от преоценка на инвестиции	108 351	97 127	-11 225	-10.36%
Приходи от валутни операции	35 719	33 454	-2 265	-6.34%
Общо	409 371	441 758	32 387	7.91%

Разходи за външни услуги	Стойност (лв.)	Стойност (лв.)	Изменение	
	за 3-то тримес.09г.	за 4-то тримес.09г.	в стойност	в %
Възнаграждение на Управляващото дружество	27 295	31 620	4 325	15.85%
Комисионни на ИП	0	1 097	1 097	-
Възнаграждение на банката депозитар	1 589	1 184	-405	-25.47%
Банкови такси и комисионни	87	274	187	215.40%
Разходи за публикации "каре"	205	202	-3	-1.54%
Разходи БФБ	29	33	3	10.87%
Разходи КФН	75	76	1	0.93%
Разходи Централен депозитар	165	165	0	0.00%
Разходи за одит	0	3 051	3 051	-
Други разходи	0	0	0	-
Общо	29 445	37 702	8 257	28.04%

Промените в портфейла по отделни позиции за периода. – 30.09.2009 г. - 31.12.2009 г могат да бъдат разгледани в следната таблица:

Структура на портфейла на фонд Паричен пазар		към 31.12.2009		към 30.09.2009	
Вид/Емитент	ISIN код	Стойност		Стойност	
		лева	% от портфейла	лева	% от портфейла
Корпоративни облигации					
ТЪ ПИРЕОС БЪЛГАРИЯ АД-СОФИЯ	BG2100004071	588 401,19	1,48%	589 793,49	3,65%
ТРАНСЛИЗИНГ ЕАД	BG2100005060	24 135,58	0,06%	48 279,59	0,30%
АГРИЛИЗИНГ ЕАД	BG2100006068	16 131,43	0,04%	32 268,50	0,20%
ТРАНСИНВЕСТМЪНТ АДСИЦ	BG2100019095	322 102,27	0,81%		
ЕЛАНА ХОЛДИНГ АД	BG2100020069	384 125,89	0,97%	396 183,41	2,45%
БЪЛГАРО АМЕРИКАНСКА КРЕДИТНА БАНКА - АД	BG2100020085	122 473,23	0,31%	118 244,33	0,73%
ЕНЕМОНА АД	BG2100021067	175 632,08	0,44%		
ЕВРОХОЛД БЪЛГАРИЯ АД	BG2100030076	175 778,74	0,44%	171 461,16	1,06%
ФЕЪРПЛЕЙ ИНТЕРНЕТЪНЪЛ	BG2100036057	508 439,22	1,28%	516 187,53	3,20%
Ипотечни облигации					
БЪЛГАРО АМЕРИКАНСКА КРЕДИТНА БАНКА - АД	BG2100020093	243 789,08	0,61%		
ДЦК					
МИНИСТЕРСТВО НА ФИНАНСИТЕ	BG2030007111		0,00%		
EUROPEAN INVESTMENT BANK	XS0271969932		0,00%	3 056 810,03	18,93%
EUROPEAN INVESTMENT BANK	XS0352902901	1 372 473,22	3,46%	1 342 561,64	8,31%
EUROPEAN INVESTMENT BANK	XS0371328021	170 309,00	0,43%		
Други активи					
Справедлива стойност на валутен форуърд				2 011,73	0,01%
Парични средства в разплащателни и набирателни сметки в лева		12 871 861,48	32,46%	102 133,26	0,63%
Парични средства в разплащателни сметки във валута		177 951,48	0,45%	4 924,53	0,03%
Депозити в лева		22 505 462,31	56,76%	9 766 019,63	60,48%
ОБЩО		39 659 066,20			

* Справедливата стойност на валутен форуърд към 31.12.2009г. е отрицателна 6 081,02 лв. и е отчетена в Други пасиви.

Сделките, покриващи валутната позиция в портфейла на фонда са форуърдни сделки, както следва:

1) брой, цена и обща стойност на рисков актив, който се хеджира:

В края на отчетния период, активите в щатски долари, в портфейла на Договорен фонд Райфайзен (България) Фонд Паричен Пазар са в размер на 122 473,23 лв., по фиксинг на БНБ за 30.12.2009г. За покриване на тази позиция и минимизиране на валутния риск, фондът има сключена 1 форуърдна валутна сделка, задължението по която възлиза на 122 768.10 лв.

Общата стойност на откритата валутна позиция е: -294.87 лв.

2) вид финансов деривативен инструмент, брой, цена, обща стойност и стойност на базовия актив:

вид деривативен инструмент: валутен форуърд

Форуърдно вземане в EUR	€ 59,677.74
Форуърдно задължение в USD	\$90,000.00
Преоценка на форуърд към 31.12.2009	- \$4,457.93
Контрагент	Райфайзенбанк (България) ЕАД
Падеж	04.02.2010

3) държава и пазар, на който е сключена сделка:

вид деривативен инструмент: валутен форуърд

пазар: извънборсов пазар / България

4) обща рискова позиция и обща хеджираща позиция на договорния фонд:

		Суми в лв.
--	--	------------

Доларови инвестиции в лв.		122,473.23
Задължения по форуърд с Райфайзенбанк (България) ЕАД/в лв./	+	-122,768.10
Открита валутна позиция в лв.	ОБЩО	-294.87
НСА в лв.		36,117,546.43
Обща рискова позиция като % от НСА		0.0008164%

Представляващи:

.....
Александър Леков
/Изп. Директор/

.....
Евелина Милтенова
/Председател на УС/