



Асет Мениджмънт

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

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 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 31.10% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Хармония, а ипотечните облигации са 3.46% от стойността на активите.

Към 30.12.2010 г. Фондът притежава акции, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 35.91% от общите активи на фонда. Чуждестранните инвестиции представляват 3.58% от активите на Ти Би Ай Хармония.

Делът на инвестициите в депозити е 10.68% от портфейла на ДФ Ти Би Ай Хармония, като тези средства са предоставени на краткосрочен депозит във връзка с ограниченията за ликвидност на Фонда.

Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 6.90% от активите на Фонда към 30.12.2010 г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.12.2010 г. е 3.38% на годишна база*, доходността за последните 12 месеца към 30.12.2010 г. е - 1.83%, а доходността от началото на годината е - 1.83%.

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 30.12.2010 г. Приходите са в размер на 1 507 044 лева, включващи преоценка 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.



Асет Мениджмънт

Приходи			
	30.6.2010	30.9.2010	30.12.2010
Приходи от лихви	35 903	49 730	62 325
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	584 235	973 433	1 334 009
Положителни курсови разлики от промяна на валутни курсове	58 987	79 350	98 340
Други финансови приходи	3 046	12 370	12 370
Общо приходи:	682 172	1 114 883	1 507 044

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

Разходи			
	30.6.2010	30.9.2010	30.12.2010
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	646 707	985 319	1 396 650
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	60 520	80 604	99 895
Разходи за външни услуги	22 573	32 945	42 578
Други разходи	1 811	2 319	3 429
Общо разходи:	731 610	1 101 187	1 542 552

Общият размер на разходите на фонда към 30.12.2010 г. е 1 542 552 лева, които включват 1 346 194 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и отрицателни валутни курсови разлики в размер на 99 895 лева.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество
 - към 30 декември 2010 – 36 530 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.79%

- б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество
 - към 30 декември 2010 – 1 397 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.07%

- в) Възнаграждение на банката депозитар
 - към 30 декември 2010 – 2 400 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.12%

- г) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие
 - към 30 декември 2010 – 2 400 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.12%



Асет Мениджмънт

д) Други разходи

- към 30 декември 2010 – 3 280 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.16%

- Други разходи по финансови операции: 2 032 лв.

- Външни услуги (КФН, БФБ, ЦД и др.): 1 248 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 46 007 лв. към месец декември. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 2.37%.

За периода са записани 1 078.6833 дяла и са обратно изкупени 52 570.5381 дяла. НСА на фонда към 30.12.2010 г. е 1 639 210 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 138 781.2336.

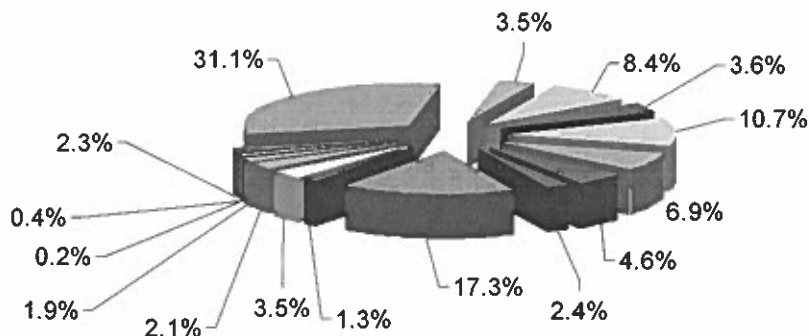
3) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „в”: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

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 30/12/2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от
Акции Холдинги	75 960	4.62%
Акции Туризм	39 052	2.38%
Акции Недвижими имоти	283 658	17.26%
Акции Миннодобивна промишленост	20 720	1.26%
Акции Фармацевтична промишленост	57 205	3.48%
Акции Тютюнева промишленост	34 863	2.12%
Акции Енергетика	30 873	1.88%
Акции Финанси	3 716	0.23%
Акции Лека промишленост	6 950	0.42%
Акции Електроника	37 301	2.27%
Корпоративни облигации	511 320	31.10%
Ипотечни облигации	56 943	3.46%
Вземания	137 282	8.35%
Колективни инвестиционни схеми	58 926	3.58%
Банкови депозити	175 639	10.68%
В брой и разплащателни сметки	113 486	6.90%
Общо активи	1 643 894	100.00%

* Вземания във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации.

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



■ Акции Холдинги	■ Акции Туризм
■ 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
■ Вземания	■ Колективни инвестиционни схеми
■ 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 31.03.2010 г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 12.0199 лв. Към 30.06.2010 г. нетната стойност на активите на един дял е 11.754 лв. Към 30.09.2010 г. нетната стойност на активите на един дял е 12.1449 лв. Към 30.12.2010 г. нетната стойност на активите на един дял е 11.8115 лв.

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



Асет Мениджмънт



5) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „е”: Сравнителна таблица за последните три финансови години, включваща общата стойност на нетните активи и нетна стойност на един дял

	Към 31 Декември 2008	Към 31 Декември 2009	Към 31 Декември 2010
Нетна стойност на активите	3 927 211	2 289 253	1 639 210
Нетна стойност на активите на един дял	11.3458	12.0314	11.8115

б) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „ж”: Задължения, възникнали от сделки с деривативни инструменти по чл. 195, ал. 1, т. 7 от ЗППЦК

Към 30.12.2010 г. Фондът не притежава активи, деноминирани във валута, различна от лева и евро, и поради тази причина няма сключени хеджиращи сделки.

Стоян Тошев
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Мирослав Маринов
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

