

**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 30.12.2009 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 30.12.2009 г. корпоративните облигации представляват 40.49% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Хармония, а ипотечните облигации са 0.43% от стойността на активите.

Към 30.12.2009 г. Фондът притежава акции, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 35.92% от общите активи на фонда и чуждестранни инвестиции в размер на 7.93% от активите.

Делът на инвестициите в депозити е 14.62% 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 0.46% от активите на Фонда към 30.12.2009 г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.12.2009 г. е 4.72% на годишна база*, а доходността за годината към 30.12.2009 г. е 6.04%.

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 30.12.2009г. Приходите са в размер на 2 627 860 лева, включващи преоценка от операции с финансови активи, приходи от лихви, положителни курсови разлики и други финансови приходи.

Приходи			
	30/06/2009	30/09/2009	30/12/2009
Приходи от лихви	56 998	79 666	101 035
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	1 561 754	2 131 864	2 469 104
Положителни курсови разлики от промяна на валутни курсове	54	68	11 703
Други финансови приходи	23 026	46 005	46 018
Общо приходи:	1 641 832	2 257 602	2 627 860

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

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

Разходи	30/06/2009	30/09/2009	30/12/2009
	Разходи от операции с финансови активи и инструменти	1 730 880	2 162 115
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	140	204	12 106
Разходи за външни услуги	26 249	37 897	49 801
Други разходи	3 378	4 131	7 236
Общо разходи:	1 760 646	2 204 347	2 611 102

Общият размер на разходите на фонда към 30.12.2009г. е 2 611 102 лева, които включват 2 541 959 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и отрицателни валутни курсови разлики в размер на 12 106 лева.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 30 декември 2009 – 43 348 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.81%

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

- към 30 декември 2009 – 4 666 лв.

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

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 30 декември 2009 – 2 891 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 2009 – 2 400 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.10%

д) Други разходи

- към 30 декември 2009 – 3 732 лв.

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

- Други разходи по финансови операции: 2 570 лв.

- Външни услуги (КФИ, БФБ, ЦД): 1 162 лв.

с) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 57 037 лв. към месец декември. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 2.38%.

За периода са записани 157.0693 дяла и са обратно изкупени 980.0094 дяла. ПСА на фонда към 30.09.2009г. е 2 335 592 лв., а към 30.12.2009г. е 2 289 253 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 190 273.0884.

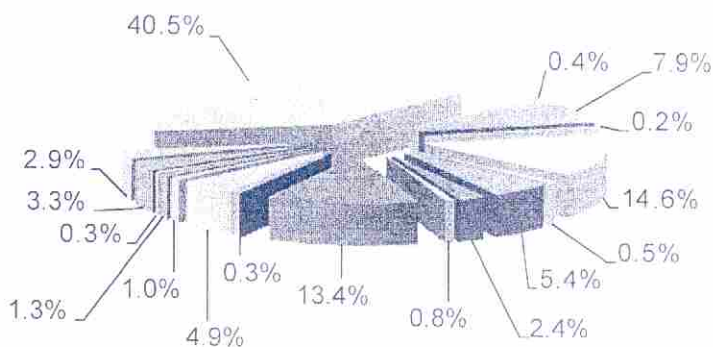
3) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „в“: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

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 30/12/2009		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
Акции Холдинги	123 296	5.37%
Акции Туризм	54 399	2.37%
Акции Машиностроене	17 719	0.77%
Акции Недвижими имоти	308 678	13.44%
Акции Миннодобивна промишленост	7 773	0.34%
Акции Фармацевтична промишленост	112 518	4.90%
Акции Тютюнева промишленост	22 909	1.00%
Акции Енергетика	29 615	1.29%
Акции Финанси	6 392	0.28%
Акции Лека промишленост	74 668	3.25%
Акции Електроника	66 769	2.91%
Корпоративни облигации	929 595	40.49%
Ипотечни облигации	9 815	0.43%
Чуждестранни инвестиции	182 056	7.93%
Вземания	3 653	0.16%
Банкови депозити	335 624	14.62%
В брой и разплащателни сметки	10 553	0.46%
Общо активи	2 296 031	100.00%

* Вземания във връзка с начислени дивиденди, лихвено плащане по емисии корпоративни облигации и от продажба на права.

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Хармония
към 30.12.2009 г.**



■ Акции Холдинги	■ Акции Туризм
■ Акции Машиностроене	■ 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 30.09.2009 г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 12.2221 лв. Към 30.12.2009 г. нетната стойност на активите на един дял е 12.0314 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	23.6996	\$45 945.68
Обща рискова позиция				\$45 945.68

Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 36 000.00	1.47060	\$52 941.60	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$52 941.60		

Стоян Тошев
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

