

**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 30.06.2010 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 30.06.2010 г. корпоративните облигации представляват 33.27% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Хармония, ипотечните облигации са 0.38% от стойността на активите, а общинските са 1.90% от стойността на активите.

Към 30.06.2010 г. Фондът притежава акции, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 35.05% от общите активи на фонда и чуждестранни инвестиции в размер на 8.12% от активите.

Делът на инвестициите в депозити е 10.70% 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 1.24% от активите на Фонда към 30.06.2010 г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.06.2010 г. е 3.65% на годишна база\*, доходността за последните 12 месеца към 30.06.2010 г. е 3.82%, а доходността от началото на годината е -2.31%.

**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 30.06.2010г. Приходите са в размер на 682 172 лева, включващи преценка от операции с финансови активи, приходи от лихви, положителни курсови разлики и други финансови приходи.

Приходи	30/12/2009	31/03/2010	30/06/2010
	Приходи от лихви	101 035	19 003
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	2 469 104	289 313	584 235
Положителни курсови разлики от промяна на валутни курсове	11 703	24 645	58 987
Други финансови приходи	46 018	189	3 046
<b>Общо приходи:</b>	<b>2 627 860</b>	<b>333 150</b>	<b>682 172</b>

\* 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			
	30/12/2009	31/03/2010	30/06/2010
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	2 541 959	298 456	646 707
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	12 106	24 814	60 520
Разходи за външни услуги	49 801	11 294	22 573
Други разходи	7 236	895	1 811
<b>Общо разходи:</b>	<b>2 611 102</b>	<b>335 459</b>	<b>731 610</b>

Общият размер на разходите на фонда към 30.06.2010г. е 731 610 лева, които включват 646 707 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и отрицателни валутни курсови разлики в размер на 60 520 лева.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 30 юни 2010 – 19 513 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.88%

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

- към 30 юни 2010 – 689 лв.

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

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 30 юни 2010 – 1200 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.05%

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

- към 30 юни 2010 – 1200 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.05%

д) Други разходи

- към 30 юни 2010 – 1781 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.08%

- Други разходи по финансови операции: 1265 лв.

- Външни услуги (КФН, БФБ, ЦД): 516 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 24 384 лв. към месец юни. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 1.10%.

За периода са записани 71.0183 дяла и са обратно изкупени 12 723.2648 дяла. НСА на фонда към 31.03.2010г. е 2 251 755 лв., а към 30.06.2010г. е 2 053 224 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 174 682.7236.

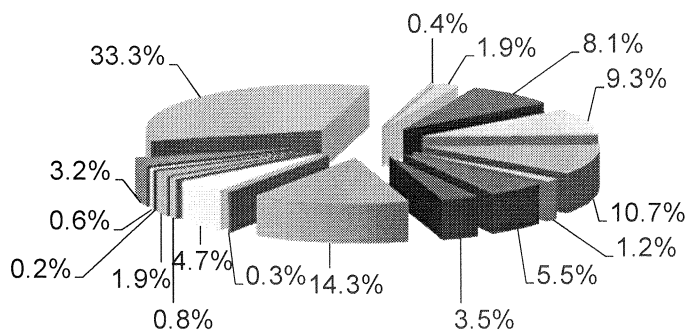
### 3) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „в”: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

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 30/06/2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
Акции Холдинги	113 787	5.53%
Акции Туризъм	72 030	3.50%
Акции Недвижими имоти	295 274	14.35%
Акции Миннодобивна промишленост	5 663	0.28%
Акции Фармацевтична промишленост	97 443	4.73%
Акции Тютюнева промишленост	16 874	0.82%
Акции Енергетика	38 981	1.89%
Акции Финанси	3 850	0.19%
Акции Лека промишленост	12 359	0.60%
Акции Електроника	65 059	3.16%
Корпоративни облигации	684 771	33.27%
Ипотечни облигации	7 852	0.38%
Общински облигации	39 199	1.90%
Чуждестранни инвестиции	167 196	8.12%
Вземания	192 129	9.33%
Банкови депозити	220 194	10.70%
В брой и разплащателни сметки	25 593	1.24%
<b>Общо активи</b>	<b>2 058 254</b>	<b>100.00%</b>

\* Вземания във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, авансово платена такса на БФБ, вземания от хеджиращи операции и други вземания.

### Разпределение на активите на Ти Би Ай Хармония към 30.06.2010 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
■ Общински 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 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.

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



## II. Данни по чл. 48, ал. 3, т. 2 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	1000.0000	32.9200	\$32 920.00

<b>Обща рискова позиция</b>	<b>\$32 920.00</b>
-----------------------------	--------------------

### Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 32 000.00	1.202920	\$38 493.44	OTC	България

<b>Обща хеджираща позиция</b>	<b>\$38 493.44</b>
-------------------------------	--------------------

Стоян Тошев  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД