

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 30.06.2009 г.: 11 921 489.1163 дяла

Към 30.09.2009 г.: 13 589 793.1098 дяла.

Период	Юни.09	Юли.09	Август.09	Септември.09
Общ брой емитирани дялове	0.0000	161 581.2143	110 628.8826	1 691 918.6586
Общ брой обратно изкупени дялове	112 516.6589	600.0000	17 288.3905	277 936.3715
Брой дялове в обръщение	11 921 489.1163	12 082 470.3306	12 175 810.8227	13 589 793.1098

б) Нетна стойност на активите на един дял

Нетната стойност на активите на дял към 30.06.2009 г. е: 1.1632 лева.

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

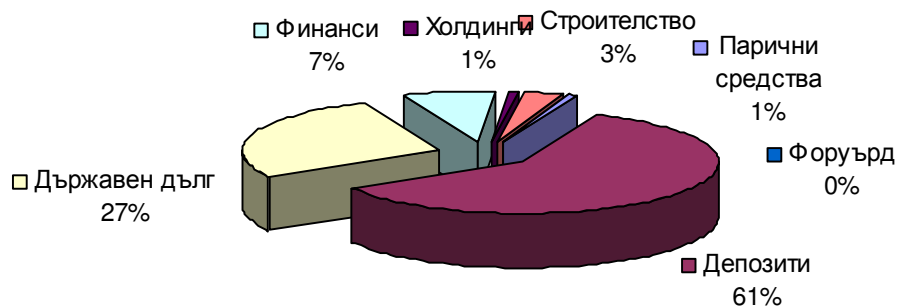
в) Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти, анализирани по най-подходящите икономически, географски или валутни показатели, съгласно политиката на договорния фонд с посочване на относителния им дял в нетните активи

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	107 057.79	0.66%	0.66%
Депозити	9 766 019.63	60.48%	60.52%
Държавен дълг	4 399 371.67	27.25%	27.26%
Финанси	788 585.91	4.88%	4.89%
Холдинги	567 644.57	3.52%	3.52%
Строителство	516 187.53	3.20%	3.20%
Форуърд	2 011.73	0.01%	0.01%
Общо	16 146 878.83	100.00 %	100.06 %

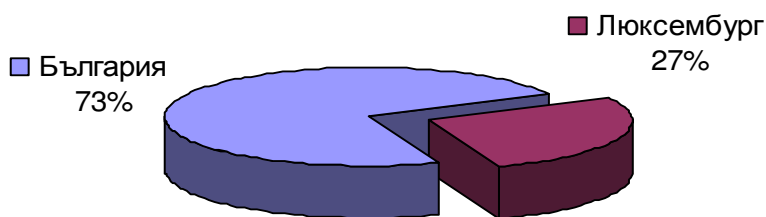
Разпределение на портфейла по отрасли (като % от НСА)



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	11 747 507.17	72.75%	72.80%
Люксембург	4 399 371.67	27.25%	27.26%
Общо	16 146 878.83	100.00%	100.06%

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 30.09.2009 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	14 862 242.58	92.04%	92.10%
EUR	1 164 380.19	7.21%	7.22%
USD	120 256.06	0.74%	0.74%
ОБЩО	16 146 878.83	100.00%	100.06%



Вземанията и задълженията на фонда са в лева и представляват съответно 0,01% и 0.06% от НСА на фонда.

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, заложиени в Проспекта на договорния фонд, както и на изискванията на съответните нормативни актове.

Активи	към 30.09.2009г.		към 31.08.2009г.		към 31.07.2009г.		към 30.06.2009г.	
	Стойност (лв.)	Дял (%)	Стойност (лв.)	Дял (%)	Стойност (лв.)	Дял (%)	Стойност (лв.)	Дял (%)
Депозити	9 766 019.63	60.48%	6 862 857.63	47.79%	6 185 345.14	43.75%	5 919 752.51	42.66%
Корпоративни облигации	1 872 418.01	11.60%	1 857 666.84	12.93%	2 374 367.89	16.79%	2 392 539.27	17.24%
ДЦК	4 399 371.67	27.25%	5 365 737.80	37.36%	5 322 942.92	37.65%	5 346 611.03	38.53%
Парични средства в разплащателни сметки в лева	107 057.79	0.66%	276 489.98	1.93%	252 906.80	1.79%	217 340.59	1.57%
Справедлива стойност на валутен форуърд	2 011.73	0.01%	-1 113.37	-0.01%	2 204.74	0.02%	770.60	0.01%
Общо	16 146 878.83	100.00%	14 361 638.88	100.00%	14 137 767.49	100.00%	13 877 013.99	100%

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 30.06.2009 г. е в размер на 13 876 863.41 лв.

Общата стойност на активите към 30.09.2009 г. е в размер на 16 147 189.21 лв.

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

Нетната стойност на активите към 30.06.2009 г. е в размер на 13 866 565.98 лв.

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

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

Разходи	Стойност (лв.)	Стойност (лв.)	Изменение	
	за 2-ро тримес.09г.	за 3-то тримес.09г.	в стойност	в %
Разходи от сделки с инвестиции	0	0	0	-
Разходи от преоценки на инвестиции	105 867	43 841	-62 025	-58.59%
Разходи за външни услуги	31 410	29 445	-1 965	-6.26%
Разходи от валутни операции	51 856	35 815	-16 040	-30.93%
Общо	189 132	109 102	-80 030	-42.31%

Приходи	Стойност (лв.)	Стойност (лв.)	Изменение	
	за 2-ро тримес.09г.	за 3-то тримес.09г.	в стойност	в %
Приходи от лихви	245 630	262 366	16 736	6.81%
Приходи от сделки с инвестиции	0	2 935	2 935	-
Приходи от преоценка на инвестиции	81 675	108 351	26 676	32.66%
Приходи от валутни операции	54 298	35 719	-18 579	-34.22%
Общо	381 603	409 371	27 768	7.28%

Разходи за външни услуги	Стойност (лв.)	Стойност (лв.)	Изменение	
	за 2-ро тримес.09г.	за 3-то тримес.09г.	в стойност	в %
Възнаграждение на Управляващото дружество	26 220	27 295	1 075	4.10%
Комисионни на ИП	0	0	0	0.00%
Възнаграждение на банката депозитар	1 610	1 589	-21	-1.30%
Банкови такси и комисионни	64	87	23	36.59%
Разходи за публикации "каре"	195	205	9	4.84%
Разходи БФБ	29	29	0	1.10%
Разходи КФН	75	75	1	1.10%
Разходи Централен депозитар	167	165	-2	-0.92%
Разходи за одит	3 051	0	-3 051	-100.00%
Други разходи	0	0	0	0.00%
Общо	31 410	29 445	-1 965	-6.26%

Промените в портфейла по отделни позиции за периода. – 30.06.2009 г. - 30.09.2009 г могат да бъдат разгледани в следната таблица:

Структура на портфейла на фонд Паричен пазар		към 30.09.2009		към 30.06.2009	
Вид/Емитент	ISIN код	Стойност		Стойност	
		лева	% от портфейла	лева	% от портфейла
Корпоративни облигации					
ТБ ПИРЕОС БЪЛГАРИЯ АД-СОФИЯ	BG2100004071	589 793.49	3.65%	588 857.10	21.92%
ТРАНСЛИЗИНГ ЕАД	BG2100005060	48 279.59	0.30%	72 471.35	9.38%
АГРИЛИЗИНГ ЕАД	BG2100006068	32 268.50	0.20%	48 437.49	3.09%
ЕЛАНА ХОЛДИНГАД	BG2100020069	396 183.41	2.45%	385 262.42	0.35%
БЪЛГАРО АМЕРИКАНСКА КРЕДИТНА БАНКА - АД	BG2100020085	118 244.33	0.73%	123 755.67	0.24%
ЕВРОХОЛД БЪЛГАРИЯ АД	BG2100030076	171 461.16	1.06%	164 570.31	0.39%
ФЕЪРПЛЕЙ ИНТЕРНЕТЪНЪЛ	BG2100036057	516 187.53	3.20%	493 145.22	2.78%
ДЦК					
МИНИСТЕРСТВО НА ФИНАНСИТЕ	BG2030105113		0.00%	1 003 724.86	0.89%
EUROPEAN INVESTMENT BANK	XS0271969932	3 056 810.03	18.93%	3 041 109.80	1.19%
EUROPEAN INVESTMENT BANK	XS0352902901	1 342 561.64	8.31%	1 301 776.37	3.55%
Други активи					
Справедлива стойност на валутен форуърд		2 011.73	0.01%	-770.6	-0.01%
Парични средства в разплащателни сметки в лева		102 133.26	0.63%	173 595.67	1.25%
Парични средства в разплащателни сметки във валута		4 924.53	0.03%	43 744.92	0.32%
Депозити в лева		9 766 019.63	60.48%	5 919 752.51	42.66%
ОБЩО		16 146 878.83	100.00%	13 875 472.80	100.00%

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 120 387.36 лв., по фиксинг на БНБ за 30.09.2009г. За покриване на тази позиция и минимизиране на валутния риск, фондът има сключена 1 форуърдна валутна сделка, задължението по която възлиза на 120 211.20 лв.

Общата стойност на откритата валутна позиция е: 176.16 лв.

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

вид деривативен инструмент: валутен форуърд

Форуърдно вземане в EUR	€62,495.66
Форуърдно задължение в USD	\$90,000.00
Преоценка на форуърд към 30.09.2009	\$1,506.15
Контрагент	Райфайзенбанк (България) ЕАД
Падеж	05.10.2009

3) държава и пазар, на който е сключена хеджиращата 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.		120,387.36
Задължения по форуърд с Райфайзенбанк (България) ЕАД/в лв./	+	-120,211.20
Открита валутна позиция в лв.	ОБЩО	176.16
НСА в лв.		16,137,065.67
Обща рискова позиция като % от НСА		0.0010916%

Представляващи:

Александър Леков
/Изп. Директор/

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