



**ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО
ЧЛ. 75 Т.2 ОТ НАРЕДБА № 44 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА
КОЛЕКТИВНИТЕ ИНВЕСТИЦИОННИ СХЕМИ, ИНВЕСТИЦИОННИТЕ
ДРУЖЕСТВА ОТ ЗАТВОРЕН ТИП И УПРАВЛЯВАЩИТЕ ДРУЖЕСТВА**

ДОГОВОРЕН ФОНД „ТИ БИ АЙ ХАРМОНИЯ”

I. Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5 от Наредба № 44, във връзка с чл.75 т.2

1) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б. „г”: Промени в структурата на портфейла през отчетния период

Съгласно инвестиционната политика и стратегия на Фонда за инвестиране предимно в акции и облигации, търгувани на регулираните пазари в страната и чужбина, през периода продължават покупките и продажбите на акции и облигации от български публични дружества, търгувани на БФБ – София АД, както и на чуждестранни инвестиции.

Към 30.06.2012г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ти Би Ай Хармония са разпределени в 6 икономически сектора. Техният дял от активите на Фонда възлиза на 16.62%.

Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 30.06.2012г. възлизат на 2.53% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 11.44% от общите активи на Фонда. Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.06.2012г. са 13.11% от стойността на портфейла.

Корпоративните облигации представляват 31.22% от активите на Фонда, докато дела на ипотечните облигации представлява 4.78%.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, начислени дивиденди, хеджиране и предварително платени такси към БФБ възлизат на 20.30% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.06.2012г. е 2.17% на годишна база*. За същия период доходността на индекса SOFIX е минус 14.52%. Доходността на Фонда за последните 12 месеца към 29.06.2012г. е минус 5.52%.

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



2) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б. „а” и „д”: Промени в състоянието на активите в рамките на отчетния период

За периода са записани 114.17 броя дялове и обратно са изкупени 28 480.9307 броя дялове. НСА на фонда към 31.12.2011г. е 1 072 558.49лв., а към 30.06.2012г.-734 297.19 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 63 838.2096.

Долната таблица представя приходите на Фонда към 30.06.2012г. Приходите са в размер на 170 531 лв., включващи приходи от операции с финансови активи, приходи от лихви и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лв.		
	30.06.2011	31.12.2011	30.06.2012
Приходи от лихви	26,575	53,963	16,803
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	509,991	761,816	127,869
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	18,111	21,204	15,352
Други приходи от финансови операции	4,222	19,875	10,507
Общо приходи:	558,899	856,858	170,531

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

Разходи	Стойност в лв.		
	30.06.2011	31.12.2011	30.06.2012
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	464,244	805,788	155,865
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	18,886	22,033	13,646
Други разходи	1,457	2,675	851
Разходи за външни услуги	17,840	31,986	10,418
Общо разходи:	502,427	862,482	180,780

Общият размер на разходите на Фонда към 30.06.2012г. е 180 780 лв., които включват 155 865 лв. разходи от операции с финансови активи и инструменти, 13 646 лв. отрицателни разлики от промяна на валутни курсове.



- а) Възнаграждение на управляващото дружество
- към 30.06.2012г. – 7 429 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.95%
- б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество
- към 30.06.2012г. – 227 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.03%
- в) Възнаграждение на банката депозитар
- към 30.06.2012г. – 1 200 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.15%
- г) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие
- към 30.06.2012г. – 1 200 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.15%
- д) Други разходи
- към 30.06.2012г. – 1 213 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.15%
- Други разходи по финансови операции: 624 лв.
- Външни услуги (КФН, БФБ, ЦД и други услуги): 589 лв.
- е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 11 269 лв. към месец юни; като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 1.44%.

	Стойност в лева		
	30/06/2011	31/12/2011	30/06/2012
Общо Приходи	558,899	856,858	170,531
Общо Разходи	502,427	862,482	180,780
Нетен Резултат	56,472	-5,624	-10,249

3) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б. „в” и „г”: 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.

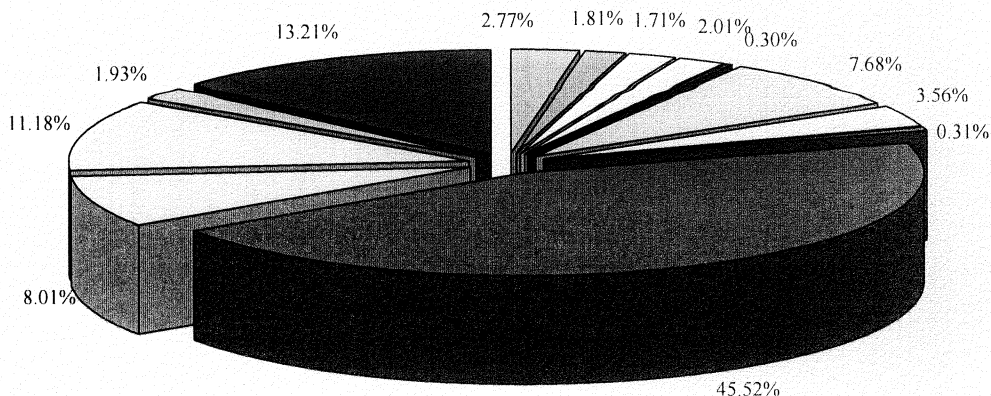


Актив	Процент		Процент		Валута (EUR, USD, BGN)
	Стойност в лева 31.12.2011	от активите 31.12.2011	Стойност в лева 30.06.2012	от активите 30.06.2012	
Акции - Холдинги	29 764	2.77%	28 671	3.88%	BGN
Акции - Тютюнева промишленост	19 456	1.81%			BGN
Акции - Фармацевтична промишленост	18 366	1.71%	14 446	1.95%	BGN
Акции - Енергетика	21 604	2.01%	8 301	1.12%	BGN
Акции- Финанси	3 224	0.30%			BGN
Акции - Недвижими имоти	82 668	7.6% ⁸	42 659	5.77%	BGN
Акции - Тежка промишленост	38 351	3.56%	26 672	3.61%	BGN
Акции – Лека промишленост	3 378	0.31%	2 141	0.29%	BGN
Чуждестранни инвестиции			18 735	2.53%	USD, EUR
Корпоративни облигации	489 898	45.52%	230 793	31.22%	EUR
Ипотечни облигации	86 223	8.01%	35 328	4.78%	EUR
Банкови депозити	120 268	11.18%	84 602	11.44%	EUR
В брой и разплащателни сметки	20 808	1.93%	96 929	13.11%	EUR, USD, BGN
Вземания	142 118**	13.21%**	150 050	20.30%	BGN, EUR
Обща сума	1076 125	100,00%	739 327	100.00%	EUR, USD, BGN

* Вземания във връзка с начислени дивиденди.
** Вземания във връзка с начислени дивиденди, лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, както и предварително платени такси към БФБ и КФН, вземания от хеджиране и др.

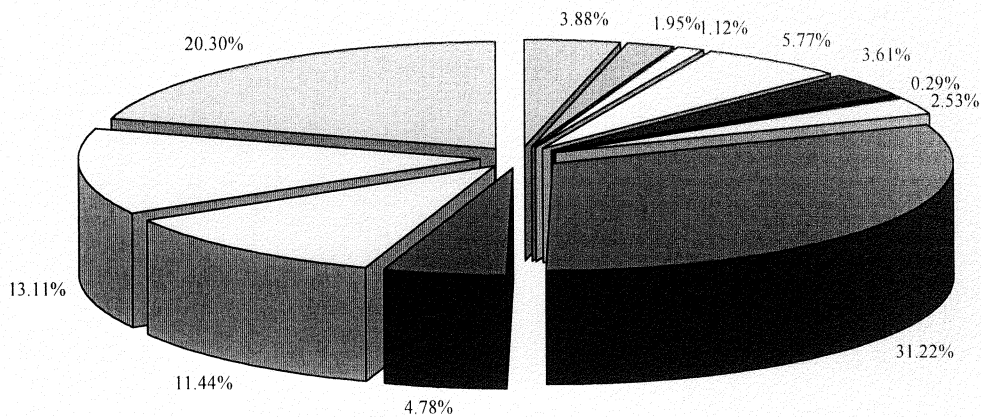


Разпределение на активите на Ти Би Ай Хармония към 31/12/2011



- | | | |
|---|--|---|
| <input type="checkbox"/> Акции - Холдинги | <input type="checkbox"/> Акции - Тютюнева промишленост | <input type="checkbox"/> Акции - Фармацевтична промишленост |
| <input type="checkbox"/> Акции - Енергетика | <input type="checkbox"/> Акции - Финанси | <input type="checkbox"/> Акции - Недвижими имоти |
| <input type="checkbox"/> Акции - Тежка промишленост | <input type="checkbox"/> Акции - Лека промишленост | <input type="checkbox"/> Корпоративни облигации |
| <input type="checkbox"/> Ипотечни облигации | <input type="checkbox"/> Банкови депозити | <input type="checkbox"/> В брой и разплащателни сметки |
| <input type="checkbox"/> Вземания* | | |

Разпределение на активите на Ти Би Ай Хармония към 30/06/2012



- | | | |
|--|---|--|
| <input type="checkbox"/> Акции - Холдинги | <input type="checkbox"/> Акции - Фармацевтична промишленост | <input type="checkbox"/> Акции - Енергетика |
| <input type="checkbox"/> Акции - Недвижими имоти | <input type="checkbox"/> Акции - Тежка промишленост | <input type="checkbox"/> Акции - Лека промишленост |
| <input type="checkbox"/> Чуждестранни инвестиции | <input type="checkbox"/> Корпоративни облигации | <input type="checkbox"/> Ипотечни облигации |
| <input type="checkbox"/> Банкови депозити | <input type="checkbox"/> В брой и разплащателни сметки | <input type="checkbox"/> Вземания* |



4) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б. „б“: Нетна стойност на активите на един дял

На 30.06.2011г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 12.2207 лв. На 31.12.2011г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 11.6323 лв. Към 30.06.2012г. нетната стойност на активите на един дял е 11.5025 лв.

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



Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

