



# Асет Мениджмънт

## 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 30.09.2011 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 30.09.2011 г. корпоративните облигации представляват 46.42% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Хармония, а ипотечните облигации 7.25% от стойността на активите.

Към 30.09.2011 г. Фондът притежава акции, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 20.60% от общите активи на фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 12.24% 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 1.65% от активите на Фонда към 30.09.2011 г.

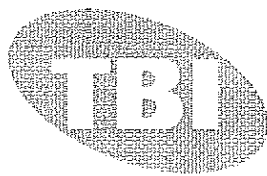
Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.09.2011 г. е 2.87% на годишна база\*, доходността за последните 12 месеца към 30.09.2011 г. е -3.07%, а доходността от началото на годината е -0.33%.

#### 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 30.09.2011 г. Приходите са в размер на 733 378 лева, включващи преценка от операции с финансови активи, приходи от лихви и положителни курсови разлики.

Приходи			
	31.3.2011	30.6.2011	30.9.2011
Приходи от лихви	12 852	26 575	40 380
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	280 104	509 991	652 202
Положителни курсови разлики от промяна на валутни курсове	885	18 111	20 921
Други финансови приходи	0	4 222	19 875
<b>Общо приходи:</b>	<b>293 842</b>	<b>558 899</b>	<b>733 378</b>

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



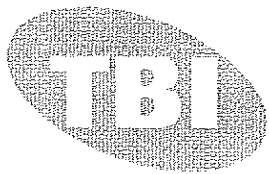
# Асет Мениджмънт

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

Разходи	31.03.2011	30.06.2011	30.09.2011
	Разходи от операции с финансови активи и инструменти	222 974	464 244
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	1 061	18 886	21 750
Разходи за външни услуги	8 848	17 841	25 224
Други разходи	647	1 457	2 460
<b>Общо разходи:</b>	<b>233 529</b>	<b>502 427</b>	<b>724 994</b>

Общият размер на разходите на фонда към 30.09.2011 г. е 724 994 лева, които включват 675 560 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и отрицателни валутни курсови разлики в размер на 21 750 лева.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество
  - към 30 септември 2011 – 20 782 лв.
  - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.35%
- б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество
  - към 30 септември 2011 – 1 007 лв.
  - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.07%
- в) Възнаграждение на банката депозитар
  - към 30 септември 2011 – 1 800 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 септември 2011 – 1 800 лв.
  - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.12%
- д) Други разходи
  - към 30 септември 2011 – 2 295 лв.
  - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.15%
  - Други разходи по финансови операции: 1 453 лв.
  - Външни услуги (КФН, БФБ, ЦД и други): 842 лв.
- е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 27 684 лв. към месец септември. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 1.79%.



# Асем Мениджмънт

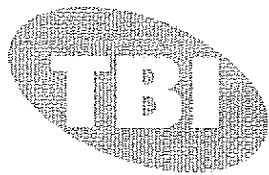
За периода са записани 30.9285 дяла и са обратно изкупени 35 997.1547 дяла. НСА на фонда към 30.09.2011 г. е 1 183 913.66 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 100 568.7843.

### 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.

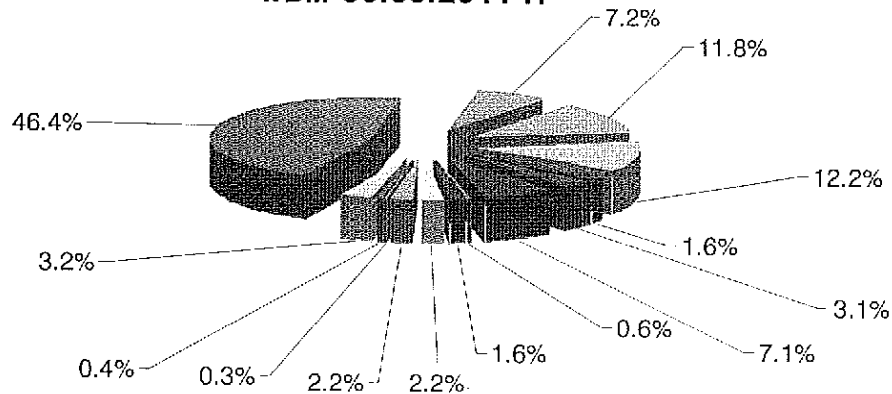
Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Хармония към 30/09/2011		
Актив	Стойност в лева	Процент от
Акции Холдинги	37 033	3.12%
Акции Недвижими имоти	84 051	7.08%
Акции Миннодобивна промишленост	6 651	0.56%
Акции Фармацевтична промишленост	19 048	1.60%
Акции Тютюнева промишленост	26 185	2.20%
Акции Енергетика	26 141	2.20%
Акции Финанси	3 064	0.26%
Акции Лека промишленост	4 922	0.41%
Акции Електроника	37 584	3.16%
Корпоративни облигации	551 405	46.42%
Ипотечни облигации	86 104	7.25%
Вземания	140 664	11.84%
Банкови депозити	145 424	12.24%
В брой и разплащателни сметки	19 597	1.65%
Общо активи	1 187 874	100.00%

\* Вземания във връзка с начислени дивиденди, лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, както и предварително платени такси за БФБ и ЦД.



# Асет Мениджмънт

## Разпределение на активите на Ти Би Ай Хармония към 30.09.2011 г.

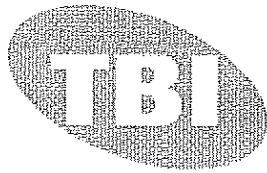


■ Акции Холдинги	■ Акции Недвижими имоти
■ Акции Миннодобивна промишленост	■ Акции Фармацевтична промишленост
■ Акции Тютонева промишленост	■ Акции Енергетика
■ Акции Финанси	■ Акции Лека промишленост
■ Акции Електроника	■ Корпоративни облигации
■ Ипотечни облигации	■ Вземания
■ Банкови депозити	■ В брой и разплащателни сметки

#### 4) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „б“: Нетна стойност на активите на един дял

На 30.09.2010г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 11.7722 лв.

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



# Асет Мениджмънт



## II. Данни по чл. 48, ал. 3, т. 2 от от Наредба № 25

Към 30.09.2011 г. Фондът не притежава активи, деноминирани във валута, различна от лева и евро, и поради тази причина няма сключени хеджиращи сделки.

Мирослав Маринов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

