

**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 30.06.2013 г. акциите на български компании в портфейла на ДФ Ти Би Ай Хармония са разпределени в 4 икономически сектора. Техният дял от активите на Фонда възлиза на 22.42%.

Фондът е закупил и чуждестранни инвестиции, които към 30.06.2013 г. възлизат на 3.94% от активите на Фонда.

Банковите депозити съставляват 16.99% от общите активи на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 30.06.2013 г. са 3.76% от стойността на портфейла.

Корпоративните облигации представляват 22.55% от активите на Фонда.

Вземанията във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, начислени дивиденди и платени такси към БФБ и КФН възлизат на 30.34% от активите на Фонда.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 28.06.2013 г. е 2.71% на годишна база. Доходността от началото на годината е 5,71%, а доходността за последните 12 месеца към 28.06.2013 г. е 6.39%.

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

Долната таблица представя приходите на Фонда към 30.06.2013 г. Приходите са в размер на 151 177 лв., включващи приходи от операции с финансови активи, приходи от лихви и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лв.		
	30.06.2012	31.12.2012	30.06.2013
Приходи от лихви	16,803	27,782	11,602
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	127,869	252,970	117,458
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	15,352	36,393	15,378
Други приходи от финансови операции	10,507	11,981	6,739
Общо приходи:	170,531	329,126	151,177

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

Разходи	Стойност в лв.		
	30.06.2012	31.12.2012	30.06.2013
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	155,865	278,877	88,396
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	13,646	35,055	15,524
Други финансови разходи	851	1,666	475
Разходи за външни услуги	10,418	19,950	9,024
Общо разходи:	180,780	335,548	113,419

Общият размер на разходите на Фонда към 30.06.2013 г. е 113 419 лв., които включват 88 396 лв. разходи от операции с финансови активи и инструменти, 15 524 лв. отрицателни разлики от промяна на валутни курсове.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество
- към 30.06.2013 г. – 6 035 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 30.06.2013 г. – 46 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.01%

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 30.06.2013 г – 1 200 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.18%

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

- към 30.06.2013 г.- 1 200 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.18%

д) Други разходи

- към към 30.06.2013 г – 1 018 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.15%

- Други разходи по финансови операции: 429 лв.

- Външни услуги (КФН, БФБ, ЦД и други услуги): 589 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 9 499 лв. към месец юни; като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 1.40%.

	Стойност в лева		
	30/06/2012	31/12/2012	30/06/2013
Общо Приходи	170,531	329,126	151,177
Общо Разходи	180,780	335,548	113,419
Нетен Резултат	(10,249)	(6,422)	37,758

За периода са записани 106.8812 броя дялове и обратно са изкупени 1 676.2334 броя дялове. НСА на фонда към 30.06.2012 г. е 734 297,19 лв., към 31.12.2012 г. е 666 193.45 лв., а към 30.06.2013 г.- 685 028,99 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 56 030.1048.

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.



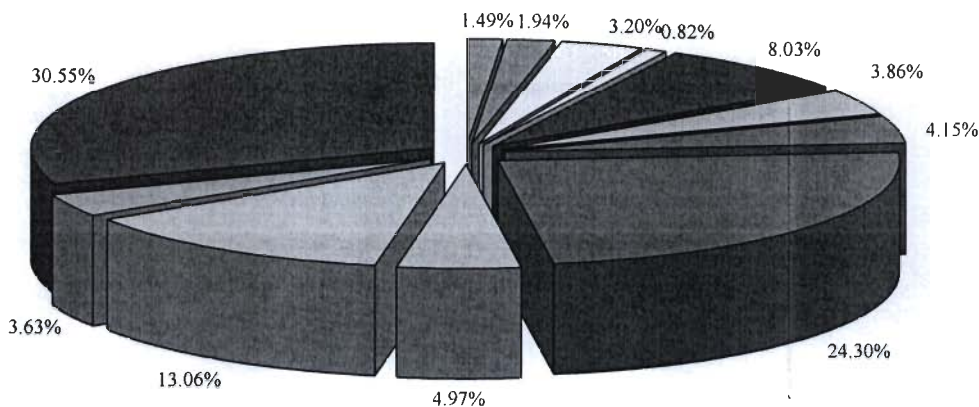
Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Хармония

Актив	Стойност в лева 31.12.2012	Процент от активите 31.12.2012	Стойност в лева 30.06.2013	Процент от активите 30.06.2013	Валута (EUR, USD, BGN)
Акции - Холдинги	10 003	1.49%	0	0%	BGN
Акции - Туризм	13 023	1.94%	17 984	2.61%	BGN
Акции - Фармацевтична промишленост	21 474	3.20%	36 132	5.23%	BGN
Акции - Енергетика	5 523	0.82%	0	0%	BGN
Акции - Недвижими имоти	53 913	8.03%	55 368	8.02%	BGN
Акции - Тежка промишленост	25 874	3.86%	45 256	6.56%	BGN
Чуждестранни инвестиции	27 838	4.15%	27 202	3.94%	USD, EUR
Корпоративни облигации	163 066	24.30%	155 658	22.55%	EUR
Ипотечни облигации	33 380	4.97%	0	0%	EUR
Банкови депозити	87 606	13.06%	117 285	16.99%	EUR
В брой и разплащателни сметки	24 342	3.63%	25 924	3.76%	EUR, USD, BGN
Вземания*	204 997	30.55%	209 443	30.34%	BGN, EUR
Обща сума	671 039	100.00%	690 252	100.00%	EUR, USD, BGN

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

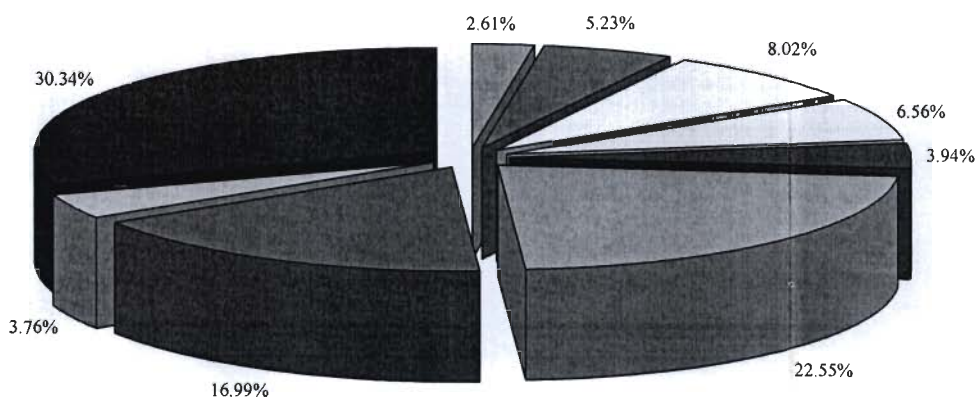


Разпределение на активите на Ти Би Ай Хармония към 31/12/2012



- Акции - Холдинги
- Акции - Туризм
- Акции - Енергетика
- Акции - Лека промишленост
- Ипотечни облигации
- Вземания*
- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Недвижими имоти
- Чуждестранни инвестиции
- Банковн депозити
- Акции - Тежка промишленост
- Корпоративни облигации
- В брой и разплащателни сметки

Разпределение на активите на Ти Би Ай Хармония към 30/06/2013



- Акции - Туризм
- Акции - Фармацевтична промишленост
- Акции - Недвижими имоти
- Акции - Тежка промишленост
- Чуждестранни инвестиции
- Корпоративни облигации
- Банковн депозити
- В брой и разплащателни сметки
- Вземания*

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

Към 30.06.2012 г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 11.5025 лв. На 31.12.2012 г. е изчислена нетна стойност на активите на един дял в размер на 11.5660 лв. Към 30.06.2013 г. нетната стойност на активите на един дял е 12.2261лв.

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



5) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5, б. „е“: Сравнителна таблица за последните три периода, включваща общата стойност на нетните активи и нетна стойност на един дял

	30/06/2012 (лв)	31/12/2012 (лв)	30/06/2013 (лв)
Нетна стойност на активите на „Ти Би Ай Хармония“	734 297.19	666 193.45	685 028.99
Нетна стойност на активите на един дял	11.5025	11.5660	12.2261

б) Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5, б. „ж“: задължения, възникнали от сделки с деривативни инструменти

Към настоящия момент, сключените от управляващото дружество сделки с деривативни инструменти са единствено с цел управление на риска – хеджиране.

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
Парични средства във валута	USD	2 802.190	1.0000	\$2 802.19
US78462F1030	USD	59.000	160.4200	\$9 464.78
US9229085538	USD	127.000	68.7200	\$8 727.44
Обща рискова позиция				\$20 994.41

Деривативен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 15 000.00	1.33640	\$20 046.00	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$20 046.00		

Красимир Петков
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД




Иван Балтов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

