



# Асем Менџмънт

## 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 30.12.2010 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 30.12.2010 г. корпоративните облигации представляват 31.10% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Хармония, а ипотечните облигации са 3.46% от стойността на активите.

Към 30.12.2010 г. Фондът притежава акции, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 35.91% от общите активи на фонда. Чуждестранните инвестиции представляват 3.58% от активите на Ти Би Ай Хармония.

Делът на инвестициите в депозити е 10.68% 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 6.90% от активите на Фонда към 30.12.2010 г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.12.2010 г. е 3.38% на годишна база\*, доходността за последните 12 месеца към 30.12.2010 г. е - 1.83%, а доходността от началото на годината е - 1.83%.

#### 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 30.12.2010г. Приходите са в размер на 1 507 044 лева, включващи преценка от операции с финансови активи, приходи от лихви, положителни курсови разлики и други финансови приходи.

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



# Асем Менџмънт

Приходи	30.6.2010	30.9.2010	30.12.2010
Приходи от лихви	35 903	49 730	62 325
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	584 235	973 433	1 334 009
Положителни курсови разлики от промяна на валутни курсове	58 987	79 350	98 340
Други финансови приходи	3 046	12 370	12 370
<b>Общо приходи:</b>	<b>682 172</b>	<b>1 114 883</b>	<b>1 507 044</b>

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

Разходи	30.6.2010	30.9.2010	30.12.2010
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	646 707	985 319	1 346 194
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	60 520	80 604	99 895
Разходи за външни услуги	22 573	32 945	42 578
Други разходи	1 811	2 319	53 884
<b>Общо разходи:</b>	<b>731 610</b>	<b>1 101 187</b>	<b>1 542 552</b>

Общият размер на разходите на фонда към 30.12.2010г. е 1 542 552 лева, които включват 1 346 194 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и отрицателни валутни курсови разлики в размер на 99 895 лева.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество
  - към 30 декември 2010 – 36 530 лв.
  - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.79%
  
- б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество
  - към 30 декември 2010 – 1 397лв.
  - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.07%
  
- в) Възнаграждение на банката депозитар
  - към 30 декември 2010 – 2 400 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 декември 2010 – 2 400 лв.
  - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.12%



# Асет Мениджмънт

д) Други разходи

- към 30 декември 2010 – 3 279 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.16%

- Други разходи по финансови операции: 2 032 лв.

- Външни услуги (КФН, БФБ, ЦД и др.): 1 247 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 46 006 лв. към месец декември. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 2.37%.

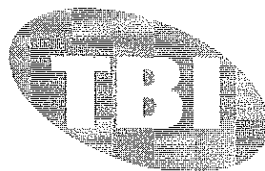
За периода са записани 42.5453 дяла и са обратно изкупени 16 251.6902 дяла. НСА на фонда към 31.03.2010 г. е 2 251 755 лв., към 30.06.2010 г. е 2 053 224 лв., към 30.09.2010 г. е 1 882 346.43 лв., а към 30.12.2010 г. - 1 639 209.73 лева Броят дялове към края на отчетния период е 138 781.2336.

### 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.

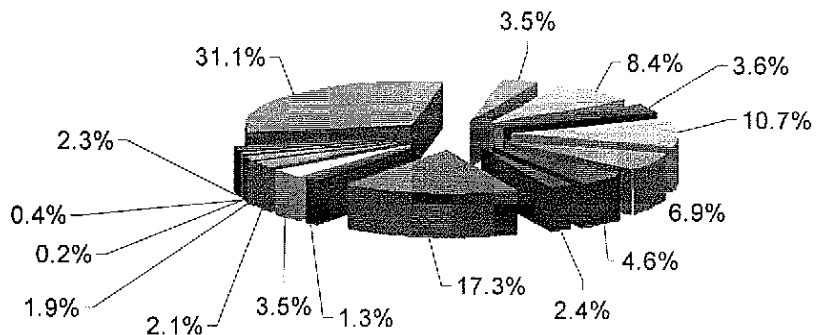
Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Хармония към 30/12/2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
Акции Холдинги	75 960	4.62%
Акции Туризм	39 052	2.38%
Акции Недвижими имоти	283 658	17.26%
Акции Миннодобивна промишленост	20 720	1.26%
Акции Фармацевтична промишленост	57 205	3.48%
Акции Тютюнева промишленост	34 863	2.12%
Акции Енергетика	30 873	1.88%
Акции Финанси	3 716	0.23%
Акции Лека промишленост	6 950	0.42%
Акции Електроника	37 301	2.27%
Корпоративни облигации	511 320	31.10%
Ипотечни облигации	56 943	3.46%
Вземания	137 280	8.35%
Чуждестранни инвестиции	58 926	3.58%
Банкови депозити	175 639	10.68%
В брой и разплащателни сметки	113 486	6.90%
Общо активи	1 643 894	100.00%

\* Вземания във връзка с лихвено и главнично плащане по емисни корпоративни облигации.



# Асет Мениджмънт

## Разпределение на активите на Ти Би Ай Хармония към 30.12.2010 г.



■ Акции Холдинги	■ Акции Туризм
■ Акции Недвижими имоти	■ Акции Миньодобивна промишленост
■ Акции Фармацевтична промишленост	■ Акции Тютюнева промишленост
■ Акции Енергетика	■ Акции Финанси
■ Акции Лека промишленост	■ Акции Електроника
■ Корпоративни облигации	■ Ипотечни облигации
■ Вземания	■ Чуждестранни инвестиции
■ 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. Към 30.09.2010 г. нетната стойност на активите на един дял е 12.1449 лв. Към 30.12.2010 г. нетната стойност на активите на един дял е 11.8115 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 30.12.2010 г. Фондът не притежава активи, деноминирани във валута, различна от лева и евро, и поради тази причина няма сключени хеджиращи сделки.

Стоян Тошев  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

Мирослав Маринов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

