

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 30.09.2010 г. са закупени и продадени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 30.09.2010 г. корпоративните облигации представляват 26.51% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Хармония, а ипотечните облигации са 0.40% от стойността на активите.

Към 30.09.2010 г. Фондът притежава акции, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 38.19% от общите активи на фонда и чуждестранни инвестиции в размер на 5.95% от активите.

Делът на инвестициите в депозити е 15% от портфейла на ДФ Ти Би Ай Хармония, като тези средства са предоставени на краткосрочен депозит във връзка с ограниченията за ликвидност на Фонда.

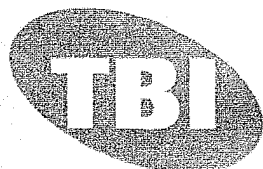
Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 4.05% от активите на Фонда към 30.09.2010 г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 30.09.2010 г. е 4.17% на годишна база*, доходността за последните 12 месеца към 30.09.2010 г. е - 0.63%, а доходността от началото на годината е 0.94%.

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 30.09.2010г. Приходите са в размер на 1 114 883 лева, включващи преоценка 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 Менѝджмънт

Приходи			
	31/03/2010	30/06/2010	30/09/2010
Приходи от лихви	19 003	35 903	49 730
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	289 313	584 235	973 433
Положителни курсови разлики от промяна на валутни курсове	24 645	58 987	79 350
Други финансови приходи	189	3 046	12 370
Общо приходи:	333 150	682 172	1 114 883

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

Разходи			
	31/03/2010	30/06/2010	30/09/2010
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	298 456	646 707	985 319
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	24 814	60 520	80 604
Разходи за външни услуги	11 294	22 573	32 945
Други разходи	895	1 811	2 319
Общо разходи:	335 459	731 610	1 101 187

Общият размер на разходите на фонда към 30.09.2010г. е 1 101 187 лева, които включват 985 319 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и отрицателни валутни курсови разлики в размер на 80 604 лева.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 30 септември 2010 – 28 428 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.34%

б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество

- към 30 септември 2010 – 809 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.04%

в) Възнаграждение на банката депозитар

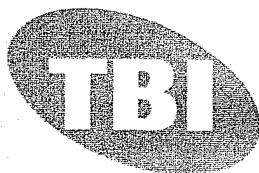
- към 30 септември 2010 – 1 800 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.08%

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

към 30 септември 2010 – 1 800 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.08%



Асет Мениджмънт

д) Други разходи

- към 30 септември 2010 – 2 427 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.11%

- Други разходи по финансови операции: 1 510 лв.

- Външни услуги (КФН, БФБ, ЦД): 917 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 35 264 лв. към месец септември. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 1.66%.

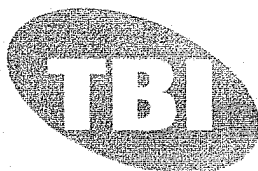
За периода са записани 557.9829 дяла и са обратно изкупени 20 250.3280 дяла. НСА на фонда към 31.03.2010 г. е 2 251 755 лв., към 30.06.2010 г. е 2 053 224 лв., а към 30.09.2010 г. е 1 882 346.43 лв. Броят дялове към края на отчетния период е 154 990.3785.

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.

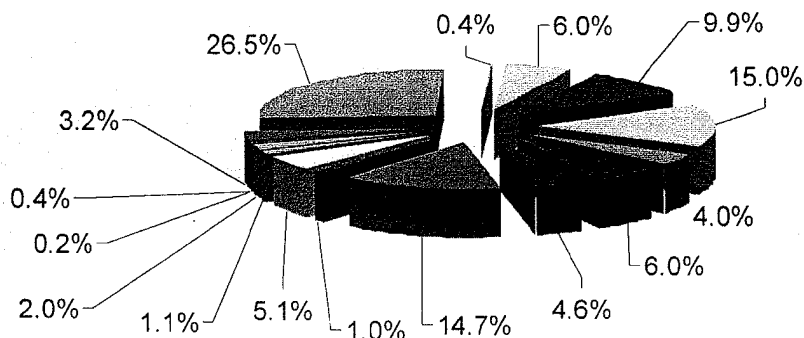
Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Хармония към 30/09/2010		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
Акции Холдинги	118 804	5.98%
Акции Туризъм	92 024	4.63%
Акции Недвижими имоти	292 414	14.71%
Акции Миннодобивна промишленост	19 716	0.99%
Акции Фармацевтична промишленост	100 447	5.05%
Акции Тютюнева промишленост	22 649	1.14%
Акции Енергетика	38 842	1.95%
Акции Финанси	3 919	0.20%
Акции Лека промишленост	7 225	0.36%
Акции Електроника	62 791	3.16%
Корпоративни облигации	526 770	26.51%
Ипотечни облигации	8 010	0.40%
Чуждестранни инвестиции	118 319	5.95%
Вземания	196 817	9.90%
Банкови депозити	298 065	15.00%
В брой и разплащателни сметки	80 385	4.05%
Общо активи	1 987 197	100.00%

* Вземания във връзка с лихвено и главнично плащане по емисии корпоративни облигации, вземания от начислени дивиденди, вземания във връзка с хеджираща сделка, авансово платена такса на БФБ и КФН.



Асет Мениджмънт

Разпределение на активите на Ти Би Ай Хармония към 30.09.2010 г.

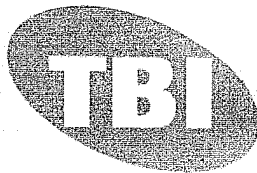


■ Акции Холдинги	■ Акции Туризъм
■ Акции Недвижими имоти	■ Акции Миннодобивна промишленост
■ Акции Фармацевтична промишленост	■ Акции Тютюнева промишленост
■ Акции Енергетика	■ Акции Финанси
■ Акции Лека промишленост	■ Акции Електроника
■ Корпоративни облигации	■ Ипотечни облигации
■ Чуждестранни инвестиции	■ 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 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.

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

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
Валутно деноминиран актив	USD	1000.0000	39.6200	\$39 620.00
Обща рискова позиция				\$39 620.00

Дериватен инструмент						
Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 32 000.00	1.268010	\$40 576.32	OTC	България
Обща хеджираща позиция				\$40 576.32		

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

