
**ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО ЧЛ. 18 ОТ НАРЕДБА № 26 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ
ДЕЙНОСТТА НА УПРАВЛЯВАЩИТЕ ДРУЖЕСТВА
ЗА ДОГОВОРЕН ФОНД „ТИ БИ АЙ ХАРМОНИЯ”**

I. Данни по чл. 18, ал. 1

1) Данни по чл. 18, ал. 1 т. 1: Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Договорен фонд Ти Би Ай Хармония стартира публичното предлагане на ценни книжа на 27 декември 2005 г. Фондът достигна минимално изискуемата нетна стойност на активите на 29 март 2006г.

Съгласно балансираната инвестиционна политика и стратегия на Ти Би Ай Хармония, през периода от началото на публичното предлагане до 29.09.2006г. са закупени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества, търгувани на БФБ-София АД.

Инвестициите в облигации представляват 33.50% от стойността на портфейла на Фонда и включват 8 емисии корпоративни облигации и една емисия общински облигации, търгувани на БФБ – София АД, една емисия корпоративни облигации, търгувани на извънборсов пазар и три емисии чуждестранни ценни книжа с експозиция към доходността на акции на международни компании - сини чипове и на компании на възникващите пазари.

През отчетния период са закупени и/или продадени акции от 5 български публични дружества, търгувани на БФБ – София АД. Те принадлежат към 5 сектора на икономиката. Делът на инвестициите в акции в портфейла на Фонда към 29.09.2006 г. е 34.53%.

Делът на инвестициите в депозити е 28.59% от портфейла, като 15.96% от тези средства са предоставени на краткосрочни депозити във връзка с ограниченията за ликвидност на Фонда.

Паричните средства в брой и по разплащателни сметки към 29.09.2006 г. са 0.73% от стойността на портфейла.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 29.09.2006г. е 15.22% на годишна база*.

2) Данни по чл. 18, ал. 1 т. 2: Стойност на портфейла в началото и в края на отчетния период

През отчетния период стойността на портфейла на Фонда нараства от 5 909 908 лева към 31.08.2006г. до 6 384 662 лева към 29.09.2006г.

3) Данни по чл. 18, ал. 1 т. 3: Извършени разходи по управление на дейността или портфейла през отчетния период

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

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

Разходи			
	31.7.2006	31.8.2006	30.9.2006
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	245 529	438 677	586 074
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	180	193	270
Разходи за външни услуги	27 150	36 403	45 175
Други разходи	2 693	2 856	3 628
Общо разходи:	275 552	478 129	635 147

Общият размер на разходите на фонда към 29.09.2006 г. е 635 147 лева, които включват 586 074 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 270 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове. Последните не са част от “всички разходи, свързани с дейността на дружеството” по чл. 171 ЗППЦК.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 29 септември 2006 – 43 448 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.30%

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

- към 29 септември 2006 – 1 081 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.03%

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 29 септември 2006 – 1000 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.03%

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

- към 29 септември 2006 – 261 лв.

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

д) Други разходи

- към 29 септември 2006г. – 3 013 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.09%

- Други разходи по финансови операции: 2 547 лв.

- Външни услуги (КФН): 466 лв.

е) Общ размер на всички разходи по букви а) – д) – 48 803 лв. към месец септември. Като процент от средната годишна нетна стойност на активите тези разходи са: 1.46 %.

4) Приходи от управление на дейността или портфейла през отчетния период

Долната таблица представя приходите на Фонда към 29.09.2006 г. Приходите са в размер на 925 237 лв., включващи преценка от операции с финансови активи и приходи от лихви.

Приходи			
	31/07/2006	31/08/2006	29/09/2006
Приходи от лихви	56 845	76 539	94 061
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	332 372	597 728	811 098
Други финансови приходи	16 673	20 176	20 078
Общо приходи:	405 889	694 443	925 237

II. Данни по чл. 18, ал. 2

1) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла в началото и в края на отчетния период

Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Хармония в началото на периода е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Хармония към 31/08/2006		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
Акции Холдинги	435 651.35	7.37%
BG1100046983	204 068.60	3.45%
BG1100019980	193 756.62	3.28%
BG1100005971	37 826.13	0.64%
Акции Туризм	205 671.90	3.48%
BG11ALBAAT17	205 671.90	3.48%
Акции Недвижими имоти	633 337.99	10.72%
BG1100025052	9 828.00	0.17%
BG1100042057	178 818.12	3.03%
BG1100109039	296 731.90	5.02%
BG1100030052	11 296.00	0.19%
BG1100019055	18 823.97	0.32%
BG1100003059	42 840.00	0.72%
Health & Wellness REIT	75 000.00	1.27%
Акции Фармацевтична промишленост	405 877.33	6.87%

BG11BAKABT17	183 731.17	3.11%
BG11SOSOBT18	222 146.16	3.76%
Акции Тютюнева промишленост	31 168.50	0.53%
BG11BLBLAT13	12 292.50	0.21%
BG11SOSOVT14	18 876.00	0.32%
Акции Електроника	6 885.60	0.12%
BG11ELPABT16	6 885.60	0.12%
Акции Телекомуникации	204 004.30	3.45%
BG1100005997	204 004.30	3.45%
Акции Финансови услуги	21 372.00	0.36%
BG1100098059	21 372.00	0.36%
Акции Химическа промишленост	220 792.18	3.74%
BG11ORRUAT13	220 792.18	3.74%
Права	25 982.12	0.44%
BG4000033069	25 982.12	0.44%
Корпоративни облигации	1 535 481.95	25.98%
BG2100032056	264 061.46	4.47%
BG2100018055	50 601.59	0.86%
BG2100036057	144 864.10	2.45%
BG2100014054	283 447.69	4.80%
BG2100002034	218 238.63	3.69%
BG2100014062	150 768.42	2.55%
BG2100017040	176 020.61	2.98%
BG2100007058	247 479.44	4.19%
Общински облигации	24 003.33	0.41%
BG2100007041	24 003.33	0.41%
Чуждестранни инвестиции	319 997.26	5.41%
DE000SG2J8T5	198 399.40	3.36%
XS0252187959	121 597.86	2.06%
Вземания*	373 240.83	6.32%
Банкови депозити	1 422 824.49	24.08%
В брой и разплащателни сметки	43 616.50	0.74%
Общо активи	5 909 907.63	100.00%

*Вземания във връзка с продажба на права, начислени дивиденди и падеж на депозит, от който паричните средства постъпват на следващия ден - 01/09/2006.

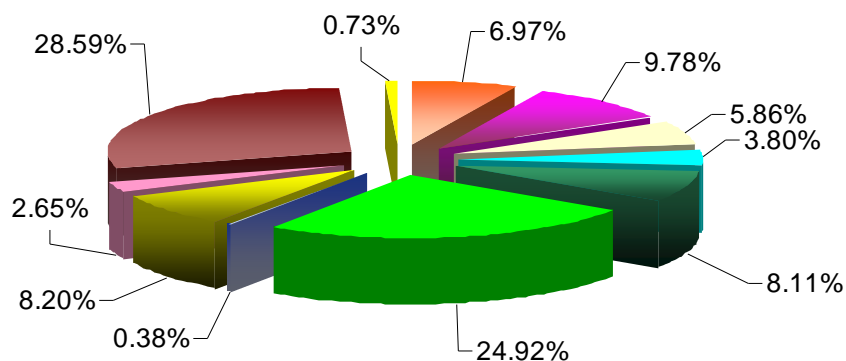
Структурата на портфейла на ДФ Ти Би Ай Хармония в края на периода е представена в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Хармония към 29/09/2006		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
Акции Холдинги	445 134.19	6.97%
BG1100046983	208 637.30	3.27%
BG1100019980	198 091.22	3.10%
BG1100005971	38 405.67	0.60%

Акции Туризм	206 121.89	3.23%
BG11ALBAAT17	206 121.89	3.23%
Акции Недвижими имоти	624 373.83	9.78%
BG1100025052	10 062.00	0.16%
BG1100042057	181 874.84	2.85%
BG1100109039	285 463.60	4.47%
BG1100030052	11 616.00	0.18%
BG1100019055	19 757.39	0.31%
BG1100003059	40 600.00	0.64%
Health & Wellness REIT	75 000.00	1.17%
Акции Фармацевтична промишленост	374 453.89	5.86%
BG11BAKABT17	194 433.53	3.05%
BG11SOSOBT18	180 020.36	2.82%
Акции Тютюнева промишленост	31 313.92	0.49%
BG11BLBLAT13	12 556.50	0.20%
BG11SOSOV14	18 757.42	0.29%
Акции Електроника	6 899.19	0.11%
BG11ELPABT16	6 899.19	0.11%
Акции Телекомуникации	222 645.35	3.49%
BG1100005997	222 645.35	3.49%
Акции Финансови услуги	21 664.50	0.34%
BG1100098059	21 664.50	0.34%
Акции Химическа промишленост	242 931.71	3.80%
BG11ORRUAT13	242 931.71	3.80%
Акции Текстилна промишленост	29 250.00	0.46%
BG11DESLAT11	29 250.00	0.46%
Корпоративни облигации	1 591 271.08	24.92%
BG2100036057	105 173.64	1.65%
BG2100018055	50 851.07	0.80%
BG2100014062	353 642.11	5.54%
BG2100007058	248 809.21	3.90%
BG2100032056	142 925.88	2.24%
BG2100002034	167 029.37	2.62%
BG2100017040	176 920.37	2.77%
BG2100014054	284 915.48	4.46%
BG2100024061	61 003.94	0.96%
Общински облигации	24 122.31	0.38%
BG2100007041	24 122.31	0.38%
Чуждестранни инвестиции	523 372.28	8.20%
DE000SG2J8T5	204 970.98	3.21%
XS0252187959	122 994.33	1.93%
XS0267513736	195 406.98	3.06%
Вземания*	169 382.46	2.65%
Банкови депозити	1 825 138.91	28.59%
В брой и разплащателни сметки	46 586.78	0.73%
Общо активи	6 384 662.29	100.00%

* Вземания във връзка с записването на акции от увеличението на капитала на дружество, търгувано на БФБ-София АД, продажба на права, начислени дивиденди и авансово платена такса за КФН.

Разпределение на активите на Ти Би Ай Хармония към 30/09/2006



Акции Холдинги	Акции Недвижими имоти
Акции Фармацевтична промишленост	Акции Химическа промишленост
Акции Други	Корпоративни облигации
Общински облигации	Чуждестранни инвестиции
Вземания	Банкови депозити
В брой и разплащателни сметки	

2) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 3: Финансово състояние на другите активи на Фонда в началото и края на периода

Към 31 август 2006г. Фондът има вземания в размер на 373 241 лв. във връзка с продажба на права, начислени дивиденди и падеж на депозит, от който паричните средства постъпват на следващия ден - 01/09/2006.

Към 29 септември 2006г. Фондът има вземания в размер на 169 382 лв. във връзка с записването на акции от увеличението на капитала на дружество, търгувано на БФБ-София АД, продажба на права, начислени дивиденди и авансово платена такса за КФН.

3) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 3: Нетна стойност на активите на Фонда в началото и в края на отчетния период

На 31 август 2006 г. е изчислена нетна стойност на активите в размер на 5 898 905 лв. Към 29 септември 2006 нетната стойност на активите е 6 368 063 лв.

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



4) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 3: Средна месечна и средна годишна нетна стойност на активите на Фонда

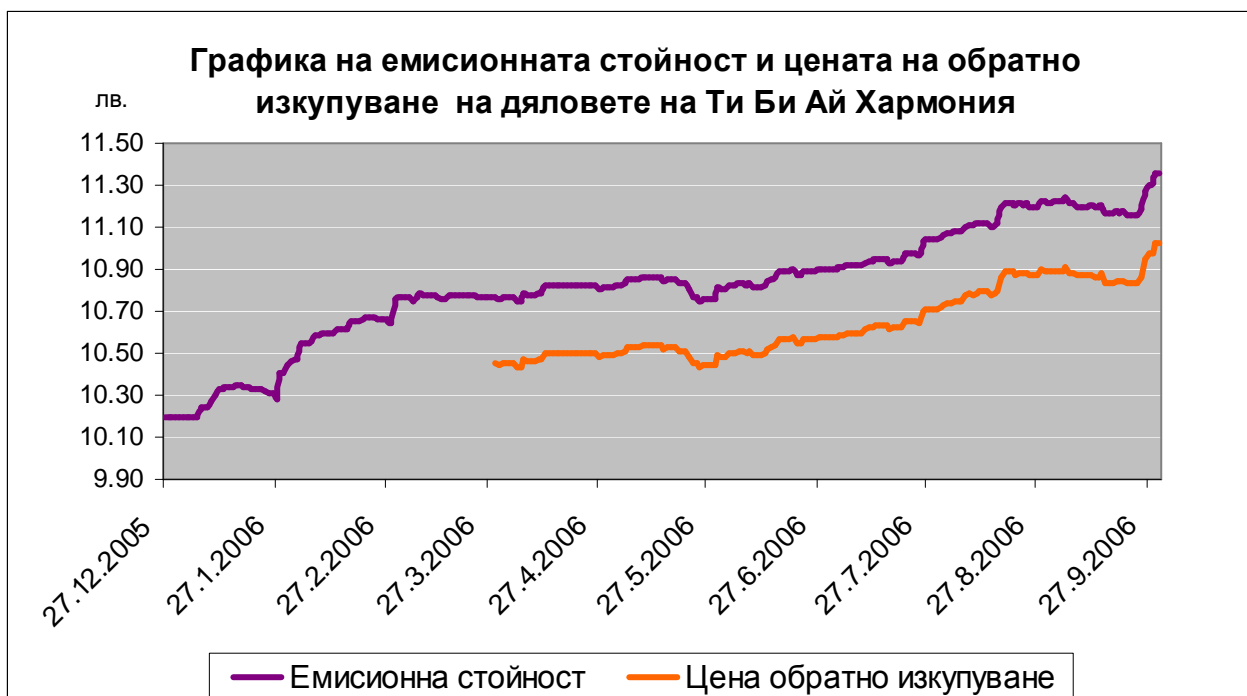
Средната месечна нетна стойност на активите на Фонда е 5 926 565 лева.
 Средната годишна нетна стойност на активите е 3 348 958 лева.

5) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 4: Данни за обявените емисионна стойност и цена на обратно изкупуване и датите на тяхното обявяване

Динамиката на емисионната стойност и цената на обратно изкупуване на дяловете на ДФ „Ти Би Ай Хармония” за периода 01/09/2006 – 29/09/2006 е представена в таблицата и графиката и по-долу:

Дата	Емисионна стойност	Цена обратно изкупуване
01.9.2006	11.2221	10.8921
02.9.2006	11.2221	10.8921
03.9.2006	11.2221	10.8921
04.9.2006	11.2399	10.9093
05.9.2006	11.2122	10.8825
06.9.2006	11.2122	10.8825
07.9.2006	11.2000	10.8706

08.9.2006	11.1993	10.8699
09.9.2006	11.1993	10.8699
10.9.2006	11.1993	10.8699
11.9.2006	11.2014	10.8720
12.9.2006	11.1926	10.8634
13.9.2006	11.1945	10.8653
14.9.2006	11.2092	10.8795
15.9.2006	11.1636	10.8353
16.9.2006	11.1636	10.8353
17.9.2006	11.1636	10.8353
18.9.2006	11.1725	10.8439
19.9.2006	11.1689	10.8404
20.9.2006	11.1738	10.8452
21.9.2006	11.1571	10.8289
22.9.2006	11.1571	10.8289
23.9.2006	11.1571	10.8289
24.9.2006	11.1571	10.8289
25.9.2006	11.1900	10.8609
26.9.2006	11.2749	10.9433
27.9.2006	11.3042	10.9717
28.9.2006	11.3126	10.9799
29.9.2006	11.3531	11.0192



6) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 5: Брой и цени на издадените (продадените) дялове

През месец септември са записани 35 690.2435 дяла.

Таблицата по-долу представя продажбата на дялове на ДФ Ти Би Ай Хармония за месец септември.

Дата	Операция	Брой дялове	Емисионна цена	Сума лв.
04.9.2006	записване	65.9413	11.22	740.00
07.9.2006	записване	22.2971	11.21	250.00
11.9.2006	записване	178.5826	11.20	2 000.00
13.9.2006	записване	44.6724	11.19	500.00
18.9.2006	записване	223.9421	11.16	2 500.00
26.9.2006	записване	357.4620	11.19	4 000.00
27.9.2006	записване	51.8203	11.27	584.27
28.9.2006	записване	133.6769	11.30	1 511.11
29.9.2006	записване	34 611.8488	11.31	391 550.00
ОБЩО		35 690.2435		403 635.38

7) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 6: Брой и цени на изкупените обратно дялове

Обратното изкупуване на дялове започна на 29.03.2006г. след като нетната стойност на активите на Фонда достигна 500 000 лева.

През месец септември обратно изкупените дялове бяха 31.0000.

Таблицата по-долу представя обратните изкупувания на дялове на ДФ Ти Би Ай Хармония за месец септември.

Дата	Операция	Брой дялове	Цена на обратно изкупуване	Сума лв.
14.Септември.06	обратно изкупуване	31.0000	10.87	336.82
ОБЩО		31.0000		336.82

В резултат на посочените по-горе записвания, към 29.09.2006г. общият брой на дяловете на Фонда възлиза на 572 126.9175 дяла.

8) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 7: Сключени сделки с активи от портфейла на Фонда.

Следващата таблица представя в обобщен вид хронологията на сделките с активи на ДФ Ти Би Ай Хармония за отчетния период.

Дата	Вид сделки	Сектори	Общ брой изтъргвани ЦК	Обща стойност на сделките
04.9.2006	покупки	Облигации	30	59 161.90
15.9.2006	покупки	Акции Текстилна промишленост	15 000	25 500.00
19.9.2006	продажби	Акции Фармацевтична промишленост	4 000	42 000.00
20.9.2006	продажби	Облигации	500	52 515.00
28.9.2006	покупки	Акции Холдинги, Туризм	90	1 543.10
28.9.2006	продажби	Акции Текстилна промишленост	419	821.24
29.9.2006	покупки	Акции Холдинги	984	13 477.85
29.9.2006	продажби	Акции Телекомуникации	16 468	167 397.48

III. Данни по чл. 18, ал. 3

Обобщена информация за отчетния период е представена в сравнителна таблица (виж Приложение I).

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД