

**ИНФОРМАЦИЯ,  
СЪГЛАСНО ЧЛ. 48 ОТНАРЕДБА № 25 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА  
ИНВЕСТИЦИОННИТЕ ДРУЖЕСТВА И ДОГОВОРНИ ФОНДОВЕ**

Съгласно балансираната инвестиционна политика и стратегия на Ти Би Ай Хармония, през периода от началото на публичното предлагане до 31.10.2007 г. са закупени ценни книжа с фиксирана доходност и акции на публични дружества.

Към 31.10.2007г. корпоративните и общинските облигации представляват 32.67% от общата стойност на активите на ДФ Ти Би Ай Хармония.

Три емисии чуждестранни ценни книжа с експозиция към доходността на акции на международни компании – сини чипове и на компании на възникващите пазари, както и дългов структуриран продукт, представляват 3.71% от стойността на портфейла на Фонда.

Към 31.10.2007г. договорният фонд притежава акции и права за участие в увеличение на капитала на компании, търгувани на БФБ – София АД, които представляват 45.80% от общите активи на фонда и дялове на взаимни фондове с експозиция към чуждестранни пазари в размер от 3.07% от общите активи. Ациите на чуждестранни компании към 31.10.2007г. представляват 1.48% от активите на Фонда.

Делът на инвестициите в депозити е 12.37% от портфейла на ДФ Ти Би Ай Хармония, като 10% от тези средства са предоставени на краткосрочни депозити във връзка с ограниченията за ликвидност на Фонда.

Парите в брой и по разплащателни сметки представляват 0.32% от активите на Фонда към 31.10.2007г.

Реализираната доходност от началото на публичното предлагане до 31.10.2007г. е 38.32% на годишна база\*, а доходността за последните 12 месеца към 31.10.07 г. е 61.53%.

**I. Данни по чл. 48, ал. 3 от Наредба № 25****1) Данни по чл. 48, ал. 3 т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейла по емитенти и видове ценни книжа и финансови инструменти**

Структура на портфейла на ДФ Ти Би Ай Хармония към 31/10/2007		
Актив	Стойност в лева	Процент от активи
<b>Акции Холдинги</b>	<b>1 362 672.40</b>	<b>7.39%</b>
BG1100046983	480 883.08	2.61%
BG1100019980	543 301.32	2.95%
BG1100005971	338 488.00	1.84%
<b>Акции Туризъм</b>	<b>421 715.52</b>	<b>2.29%</b>
BG11ALBAAT17	421 715.52	2.29%
<b>Акции Машиностроене</b>	<b>226 142.39</b>	<b>1.23%</b>
BG11MPKAAT18	124 542.95	0.68%
BG11HIYMAT14	31 090.00	0.17%
BG11ELLOAT15	70 509.44	0.38%

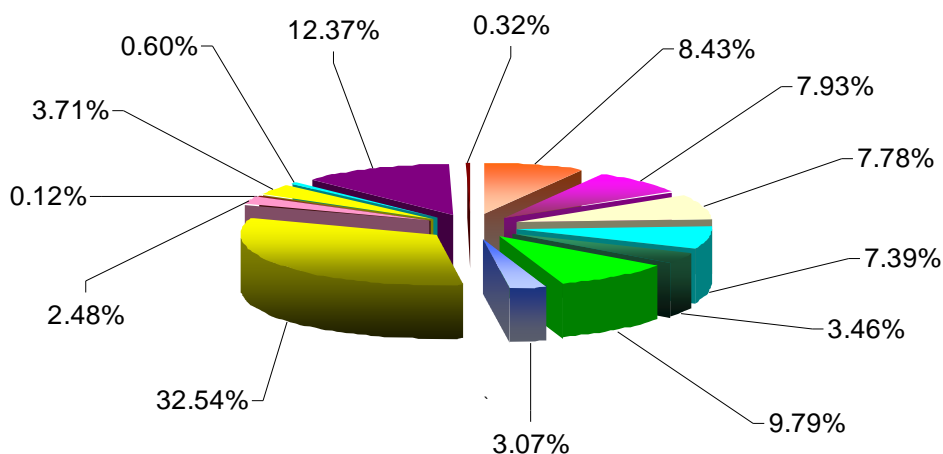
\* Доходността е изчислена въз основа на нетната стойност на активите на един дял на съответните дати.

<b>Акции Минодобивна промишленост</b>	<b>104 333.04</b>	<b>0.57%</b>
BG1100039012	104 333.04	0.57%
<b>Акции Недвижими имоти</b>	<b>1 462 263.82</b>	<b>7.93%</b>
BG1100042057	419 795.93	2.28%
BG1100109039	251 840.00	1.37%
BG1100030052	24 820.00	0.13%
BG1100003059	105 768.00	0.57%
BG1100019055	10 141.69	0.06%
BG1100110060	74 800.00	0.41%
BG1100069068	156 384.00	0.85%
BG1100013074	75 000.00	0.41%
BG1100039061	118 714.20	0.64%
City Property ADSIC	75 000.00	0.41%
Efekten und Finanz ADSIC	75 000.00	0.41%
Balkan Property ADSIC	75 000.00	0.41%
<b>Акции Фармацевтична промишленост</b>	<b>637 613.94</b>	<b>3.46%</b>
BG11BAKABT17	219 013.94	1.19%
BG11SOSOBT18	418 600.00	2.27%
<b>Акции Тютюнева промишленост</b>	<b>39 425.03</b>	<b>0.21%</b>
BG11BLBLAT13	17 735.03	0.10%
BG11SOSOV14	21 690.00	0.12%
<b>Акции Енергетика</b>	<b>79 662.91</b>	<b>0.43%</b>
DE0007614406	79 662.91	0.43%
<b>Акции Търговия</b>	<b>31 378.11</b>	<b>0.17%</b>
BG1100093068	31 378.11	0.17%
<b>Акции Химическа промишленост</b>	<b>1 433 888.80</b>	<b>7.78%</b>
BG11ORRUAT13	1 433 888.80	7.78%
<b>Акции Лека промишленост</b>	<b>479 278.82</b>	<b>2.60%</b>
BG11DESLAT11	75 517.84	0.41%
BG11KAGAAT13	104 032.50	0.56%
BG1100082061	55 860.06	0.30%
BG11DRPLAT19	79 862.46	0.43%
BG1100053070	74 005.96	0.40%
BG1100043071	90 000.00	0.49%
<b>Акции Финанси</b>	<b>314 434.79</b>	<b>1.71%</b>
BG1100129052	231 276.42	1.25%
AT0000606306	83 158.37	0.45%
<b>Акции Електроника</b>	<b>1 554 513.46</b>	<b>8.43%</b>
BG1100075065	1 521 863.26	8.26%
BG11EMSEAT19	32 650.20	0.18%
<b>Акции Нефт и газ</b>	<b>73 040.47</b>	<b>0.40%</b>
US3682872078	73 040.47	0.40%
<b>Акции Автомобилна индустрия</b>	<b>36 042.82</b>	<b>0.20%</b>
DE0005439004	36 042.82	0.20%
<b>Взаимни фондове</b>	<b>565 754.75</b>	<b>3.07%</b>
LU0119336021	73 033.61	0.40%
LU0119365988	86 979.27	0.47%
LU0168045416	405 741.87	2.20%
<b>Корпоративни облигации</b>	<b>5 998 558.36</b>	<b>32.54%</b>

BG2100036057	226 948.61	1.23%
BG2100030068	164 665.12	0.89%
BG2100001051	182 147.92	0.99%
BG2100006050	1 988.38	0.01%
BG2100018055	50 893.40	0.28%
BG2100014062	257 481.08	1.40%
BG2100032056	101 414.09	0.55%
BG2100002034	101 425.50	0.55%
BG2100017040	144 085.46	0.78%
BG2100014054	304 882.71	1.65%
BG2100024061	175 019.68	0.95%
BG2100031066	534 865.92	2.90%
BG2100019061	314 902.32	1.71%
BG2100001077	860 561.05	4.67%
BG2100007074	650 290.15	3.53%
BG2100037063	290 569.48	1.58%
BG2100010078	276 204.82	1.50%
BG2100016075	300 949.02	1.63%
BG2100019079	151 253.67	0.82%
BG2100023071	908 009.97	4.93%
<b>Права</b>	<b>457 820.14</b>	<b>2.48%</b>
BG4000027079	163 468.94	0.89%
BG4000028077	293 596.64	1.59%
BG4000030073	754.56	0.00%
<b>Общински облигации</b>	<b>22 626.24</b>	<b>0.12%</b>
BG2100007041	16 140.13	0.09%
BG2100003057	6 486.11	0.04%
<b>Чуждестранни облигации</b>	<b>683 352.10</b>	<b>3.71%</b>
DE000SG2J8T5	229 692.68	1.25%
XS0252187959	166 437.22	0.90%
XS0301590047	287 222.21	1.56%
<b>Вземания*</b>	<b>109 677.24</b>	<b>0.60%</b>
<b>Банкови депозити</b>	<b>2 279 989.85</b>	<b>12.37%</b>
<b>В брой и разплащателни сметки</b>	<b>58 825.52</b>	<b>0.32%</b>
<b>Общо активи</b>	<b>18 433 010.50</b>	<b>100.00%</b>

\* Вземания, свързани с участието в увеличението на капитала на едно дружество, вземания във връзка с продажба на ценни книжа, начислени дивиденди, вземане във връзка с валутна сделка и авансово платена такса за поддържане на емисия на БФБ - София АД.

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Хармония  
 към 31.10.2007 г.**



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

**2) Данни по чл. 48, ал. 3, т. 2 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
LU0168045416	USD	465.708	643.549	\$299 705.92
US3682872078	USD	4 400	12.26	\$53 952.32
XS0301590047	USD	200 000	106.08%	\$212 160.00

<b>Обща рискова позиция</b>	<b>\$565 818.24</b>
-----------------------------	---------------------

**Дериватен инструмент**

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
форуърден договор	EUR/USD	€ 357 000.00	1.41567	-\$505 394.19	ОТС	България
форуърден договор	EUR/USD	€ 28 000.00	1.4377	-\$40 255.60	ОТС	България

<b>Обща хеджираща позиция</b>	<b>-\$545 649.79</b>
-------------------------------	----------------------

Стоян Тошев  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД