

Информация по чл. 73д, т. 2 от Наредба № 25

за изискванията към дейността на инвестиционните дружества и договорните фондове
Договорен фонд "Райфайзен (България) Балансиран Доларов Фонд"

а) Брой дялове в началото и края на отчетния период

В началото и края на отчетния период броят дялове в обръщение на Райфайзен (България) Балансиран Доларов Фонд е, както следва:

Към 30.06.2011 г.: 3 546 841.2741 дяла.

Към 30.09.2011 г.: 2 885 788.7398 дяла.

Период	Юни.11	Юли.11	Август.11	Септември.11
Общ брой емитирани дялове	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
Общ брой обратно изкупени дялове	101 528.8250	14 217.4695	643 253.7146	3 581.3502
Брой дялове в обръщение	3 546 841.2741	3 532 623.8046	2 889 370.0900	2 885 788.7398

б) Нетна стойност на активите на един дял

Нетната стойност на активите на дял към 30.06.2011 г. е: 0.7404 USD.

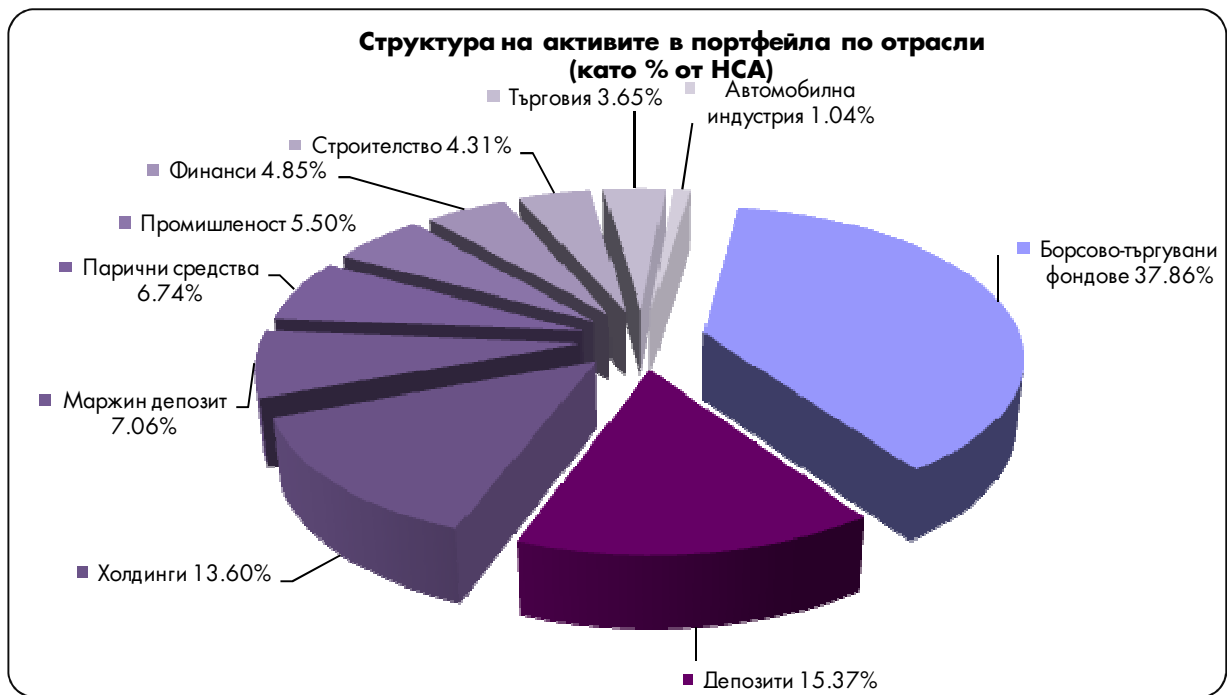
Нетната стойност на активите на дял към 30.09.2011 г. е: 0.6645 USD.

в) Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти, анализирани по най-подходящите икономически, географски или валутни показатели, съгласно политиката на договорния фонд с посочване на относителния им дял в нетните активи

1. Обем и структура на инвестициите в портфейла по отрасли като процент от общата нетна стойност на активите

Разпределението на активите в портфейла на фонда по отрасли е представено в таблицата по-долу.

Отрасъл	Стойност на актив USD	Стойност на актив BGN	% от портфейла	% от НСА
Борсово-търгувани фондове	725 982.51	1 051 542.10	37.86%	37.86%
Депозити	294 702.83	426 859.36	15.37%	15.37%
Холдинги	260 762.43	377 698.73	13.60%	13.60%
Маржин депозит	135 441.25	196 178.52	7.07%	7.06%
Парични средства	129 230.91	187 183.22	6.74%	6.74%
Промисленост	105 494.52	152 802.48	5.50%	5.50%
Финанси	93 068.10	134 803.56	4.86%	4.85%
Строителство	82 682.06	119 760.00	4.31%	4.31%
Търговия	70 023.00	101 424.12	3.65%	3.65%
Автомобилна индустрия	20 000.00	28 968.80	1.04%	1.04%
Общо	1 917 387.60	2 777 220.89	100.00%	99.99%



2. Обем и структура на инвестициите в портфейла по географско разпределение (държава, в която е регистрирано дружеството емитент) като процент от общата нетна стойност на активите

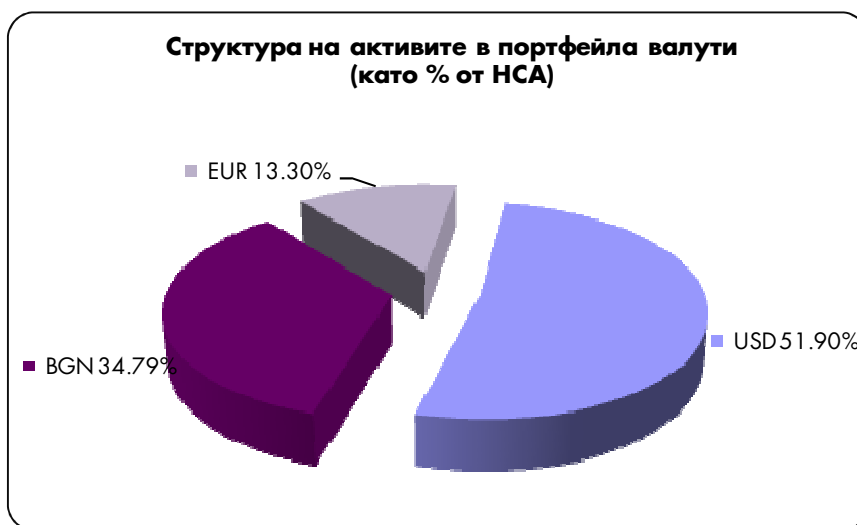
Държава	Стойност на актив USD	Стойност на актив BGN	% от портфейла	% от НСА
България	1 171 405.09	1 696 709.99	61.09%	61.09%
САЩ	745 982.51	1 080 510.90	38.91%	38.90%
Общо	1 917 387.60	2 777 220.89	100.00%	99.99%



3. Обем и структура на инвестициите в портфейла по валути като процент от общата нетна стойност на активите

Към 30.09.2011 г. инвестициите в портфейла на ДФ "Райфайзен (България) Балансиран Доларов Фонд" представляват дялови ценни книжа, депозити и парични средства по разплащателни сметки в лева и валута. В зависимост от валутата на инвестицията, те са разпределени в общата нетна стойност на активите на фонда, както следва:

Валута	Стойност на актив USD	Стойност на актив BGN	% от портфейла	% от НСА
USD	995 208.61	1 441 499.96	51.90%	51.90%
BGN	667 209.49	966 412.91	34.80%	34.79%
EUR	254 969.50	369 308.02	13.30%	13.30%
Общо	1 917 387.60	2 777 220.89	100.00%	99.99%



Вземанията и задълженията на фонда представляват съответно 0.32% и 0.32% от НСА на фонда. През отчетния период разходи за бъдещи периоди са в размер на 0.01% от НСА.

г) Промени в структурата на портфейла, които са настъпили през отчетния период

Промените в структурата на портфейла на ДФ "Райфайзен (България) Балансиран Доларов Фонд", направени през отчетния период, изцяло отговарят на инвестиционната политика и рисковата насоченост, заложи в Проспекта на договорния фонд, както и на изискванията на съответните нормативни актове.

Активи	СТРУКТУРА НА ПОРТФЕЙЛА					
	Към 30.09.2011г.			Към 30.06.2011г.		
	Стойност (USD)	Стойност (лв.)	Дял от портфейла (%)	Стойност (USD)	Стойност (лв.)	Дял от портфейла (%)
Парични средства	129 230.91	187 183.22	6.74%	130 253.97	176 263.58	4.95%
Депозити	294 702.83	426 859.36	15.37%	420 826.26	569 474.72	15.99%
Маржин депозит	135 441.25	196 178.52	7.06%	111 198.75	150 477.48	4.22%
Корпоративни облигации	199 976.91	289 654.56	10.43%	467 025.54	631 992.97	17.75%
Ипотечни облигации	49 766.34	72 083.56	2.60%	51 766.56	70 052.06	1.97%
Дялове	725 982.51	1 051 542.10	37.86%	862 569.50	1 167 254.93	32.78%
Акции	382 286.85	553 719.57	19.94%	587 899.28	795 562.94	22.34%
Общо	1 917 387.60	2 777 220.89	100.00%	2 631 539.86	3 561 078.68	100.00%

д) Промени в състоянието на активите в рамките на отчетния период, включващи приходи от инвестиции, други приходи, разходи за управление, такса за обслужване на банката депозитар, други плащания и данъци, нетни приходи, разпределение на дохода и инвестиции на този доход, промени в капитала, нарастване или спад на инвестициите и всички други промени, които са се отразили в стойността на активите и пасивите.

Обща стойност на активите в началото и в края на отчетния период

Общата стойност на активите към 30.06.2011 г. е в размер на 2 632 179.45USD.

Общата стойност на активите към 30.09.2011 г. е в размер на 1 923 669.22USD.

Нетна стойност на активите в началото и в края на отчетния период

Нетната стойност на активите към 30.06.2011 г. е в размер на 2 626 187.89 USD.

Нетната стойност на активите към 30.09.2011 г. е в размер на 1 917 607.01 USD.

В таблиците по-долу са представени извършените разходи и приходи на фонда по тримесечия – за третото тримесечие на 2011г. и за второто тримесечие на 2011г. В последните колони е изчислено увеличението/намалението на съответните суми третото тримесечие на 2011г. спрямо второто тримесечие на 2011г., в стойностно и процентно изражение.

Разходите за външни услуги са показани подробно.

Разходи	Стойност (лв.)	Стойност (лв.)	Изменение	
	за 3-то тримес. 11г.	за 2-ро тримес. 11г.	в стойност	в %
Разходи от сделки с инвестиции	21 921	6 448	15 473	239.97%
Разходи от преоценка на инвестиции	1 747 422	904 019	843 403	93.29%
Разходи за външни услуги	30 122	36 411	-6 289	-17.27%
Разходи по валутни операции	1 856 715	1 850 988	5 727	0.31%
Други разходи	0	0	0	-
Общо	3 656 180	2 797 866	858 313	30.68%

Приходи	Стойност (лв.)	Стойност (лв.)	Изменение	
	за 3-то тримес. 11г.	за 2-ро тримес. 11г.	в стойност	в %
Приходи от сделки с инвестиции	157 257	18 874	138 383	733.19%
Приходи от преоценки на инвестиции	1 283 149	789 440	493 709	62.54%
Приходи от лихви	19 033	23 396	-4 363	-18.65%
Приходи от валутни операции	1 668 777	1 879 836	-211 059	-11.23%
Приходи от дивиденди	24 589	652	23 937	3671.32%
Общо	3 152 805	2 712 198	440 607	16.25%

Разходи за външни услуги	Стойност (лв.)	Стойност (лв.)	Изменение	
	за 3-то тримес. 11г.	за 2-ро тримес. 11г.	в стойност	в %
Възнаграждение на Управляващото дружество	18 438	21 435	-2 997	-13.98%
Комисионни на ИП	2 979	4 310	-1 331	-30.88%
Възнаграждение на банката депозитар	2 268	2 460	-192	-7.80%
Банкови такси и комисионни	4 241	7 652	-3 411	-44.58%
Разходи за публикации "каре"	214	204	10	4.90%
Разходи БФБ	30	30	0	0.00%
Разходи КФН	115	95	20	21.05%
Разходи Централен депозитар	152	152	0	0.00%
Разходи за одит	1 685	0	1 685	-
Други разходи	0	72	-72	-100.00%
Общо	30 122	36 410	-6 288	-17.27%

Деривативните финансови инструменти в портфейла на Райфайзен (България) Балансиран Доларов Фонд, към 30.09.2011г., са 5бр. валутни фючърси, които покриват позицията на недоларовите активи на фонда. Фючърските контракти са тримесечни, с падеж 19.12.2011г. и информацията за тях е представена по-долу.

1) брой, цена и обща стойност на рисков актив, който се хеджира:

Към 30.09.2011 Договорен фонд Райфайзен (България) Балансиран Доларов Фонд има сключени 5 декемврийски фючърсни контракти, които касаят валутната позиция на фонда. Общата стойност на откритата позиция възлиза на 118,713.98 лв.

2) вид финансов деривативен инструмент, брой, цена, обща стойност и стойност на базовия актив:

вид деривативен инструмент: валутни фючърси

Позиция в контракти	5
Фючърсно задължение в EUR (5*EUR125,000)	- € 625,000.00
Фючърсно вземане в USD	\$879,062.50
Преоценка на позицията към 30.6.2011	\$31,812.50
Контрагент	Борса CME
Падеж	19.12.2011

3) държава и пазар, на който е сключена хеджиращата сделка:

вид деривативен инструмент: валутни фючърси

пазар: борсов пазар / Chicago Mercantile Exchange, САЩ

4) обща рискова позиция и обща хеджираща позиция на договорния фонд:

		Суми в лв.
Недоларови инвестиции		886,488.89
Парични средства в разпл. с/ки в лева	+	441,662.14
Парични средства в разпл. с/ки в евро	+	7,569.90
		8,745.05
	ОБЩО	1,344,465.98
Задължения по фючърсни контракти /в лв./	+	-1,222,393.75
Задължения		-3,358.25
	ОБЩО	-1,225,752.00
Открита позиция	ОБЩО	118,713.98
НСА в лв		2,777,538.70
Обща рискова позиция позиция като % от НСА		4.27%

Данни относно разкритата вътрешна информация за периода от 01.07.2011 до 30.09.2011 г. съгласно чл. 73в, т. 3 от Наредба № 25:

С писмо до КФН, вх.№ РГ-08-13/15 от 18.08.2011г., е оповестена вътрешна информация за значително намаляване на активите / с 11.84% / и дяловете в обръщение на ДФ "Райфайзен (България) Балансиран Доларов Фонд", в резултат на обратно изкупени дялове на голям клиент.

Представяващи:

.....
Александър Леков
/Изп. Директор/

.....
Евелина Милтенова
/Председател на УС/