

**ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО ИЗИСКВАНИЯТА НА ЧЛ. 48 ОТ НАРЕДБАТА  
ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА ИД И ДФ И 18 ОТ НАРЕДБАТА ЗА  
ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА УПРАВЛЯВАЩИТЕ ДРУЖЕСТВА**

**ИД ТИ БИ АЙ ЕВРОБОНД АД**

**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***

Съгласно инвестиционната политика и стратегия на ИД за инвестиране в дългови ценни книжа, търгувани на регулираните пазари в страната и чужбина през периода са закупени и продадени държавни ценни книжа и корпоративни облигации, деноминирани в евро и лева. Делът на ипотечните и корпоративни облигации е съответно 4.11% и 38.28%, от които 2.01% в чуждестранни ценни книжа. Инвестициите в държавни ценни книжа, емитирани по вътрешния дълг на Република България са 10.29% от активите на инвестиционното дружество. Средствата, инвестирани в общински облигации съставляват 1.69% от всички активи. Паричните средства по депозити и разплащателни сметки са 45.63%. Активите, деноминирани във валута са 77.91%. Доходността, постигната от началото на публичното предлагане (17 ноември 2003 г.) е 9.56%<sup>1</sup>.

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

Стойността на портфейла към 31/08/2006 и 29/09/2006 е съответно 18 862 590 лв. и 18 654 481 лв.

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

Разходите на дружеството по отчетни периоди може да се проследи от таблицата по-долу:

Разходи	Стойност в лв.		
	31.07.2006	31.08.2006	29.09.2006
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	701 565	772 385	827 147
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	1 144 959	1 263 257	1 328 136
Заплати, социално и пенсионно осигуряване	9 976	11 481	12 987
Други разходи	1706	2411	2610

<sup>1</sup> Доходността е изчислена през нетната стойност на активите на 1 акция за съответните дати.

Разходи за външни услуги	170 875	191 779	210 669
<b>Общо разходи:</b>	<b>2 029 080</b>	<b>2 241 314</b>	<b>2 381 549</b>

Общият размер на разходите на дружеството към 30/09/2006 г. са 2 381 549 лева, които включват 1 328 136 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 827 147 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 – 198 002 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.96%

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

- към 29 септември – 929 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.00%

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 29 септември – 1 869 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.009%

г) Възнаграждение на членовете на управителните и на контролните органи на дружеството

- към 29 септември – 12 203 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.06%

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

- към 29 септември – 628 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.003%

е) Други разходи на инвестиционното дружество

- към 29 септември – 12 635

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.06%

- Други разходи по финансови операции в размер на 1 681 лв.

- Разходи за възнаграждения – 4 916 лв.

- Разходи за външни услуги (КФН, БФБ, ЦД, в-к „Пари”, в-к „Дневник”) – 6 038 лв.

ж) Общ размер на всички разходи по букви а) – е) – 226 266 лв. към месец септември; като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.10%

Долната таблица представя приходите на Дружеството към 31.07.2006, 31.08.2006 и 29.09.2006 г. Приходите са в размер на 3 216 214 лв, включващи преценка от операции с финансови активи и приходи от лихви.

Приходи	Стойност в лв.		
	31.07.2006	31.08.2006	29.09.2006
Приходи от лихви	873 101	992 141	1 098 191
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	1 080 051	1 224 629	1 307 213
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	689 060	761 349	810 810
<b>Общо приходи:</b>	<b>2 642 212</b>	<b>2 978 119</b>	<b>3 216 214</b>

## II. Данни по чл. 18, ал. 2

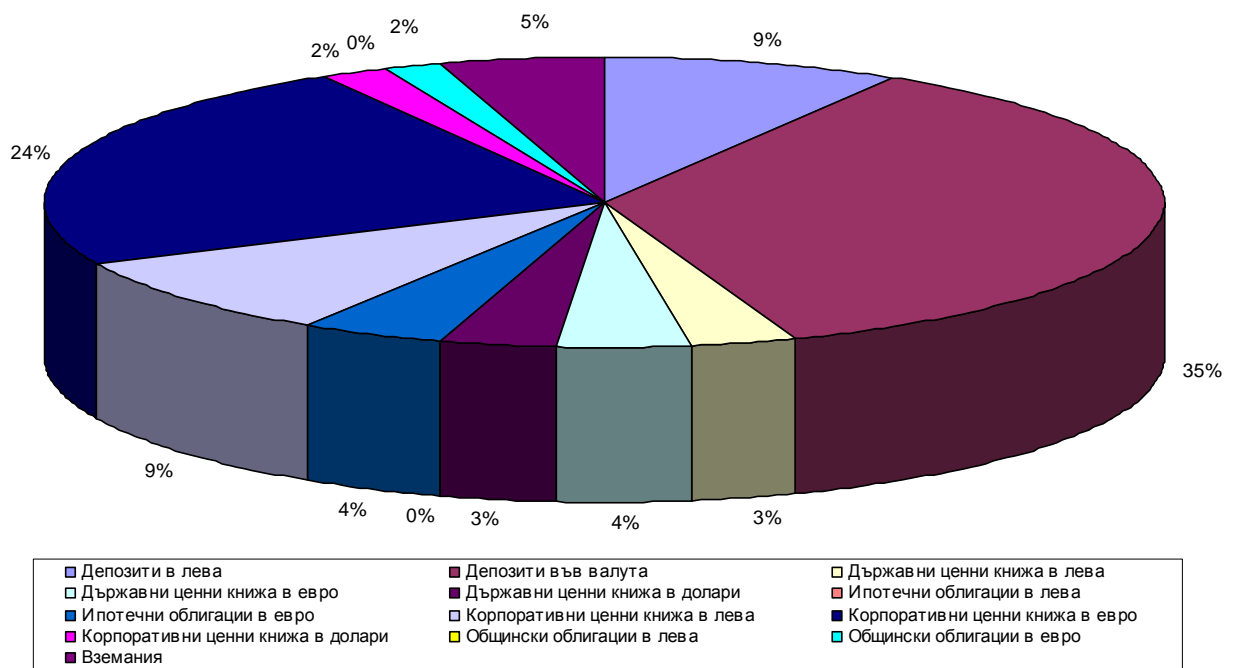
1 ) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 1: *Обем и структурата на инвестициите в портфейла, в т.ч. по отрасли в началото и в края на периода*

Структурата и обема на инвестициите в портфейла на ИД Ти Би Ай Евробонд в началото на периода са представени в следната таблица и графика.

Структура на портфейла на Ти Би Ай Евробонд АД към 31/08/2006		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Парични средства в каса в лева	774	0.00%
Парични средства в разплащателни сметки в лева	6 652	0.04%
Парични средства в разплащателни сметки във валута	1 383	0.01%
Депозити в лева	1 612 947	8.55%
Депозити във валута	6 751 227	35.79%
Дългови ценни книжа		
<i>Държавни ценни книжа</i>	<b>1 951 200</b>	<b>10.34%</b>
BG 2040099223	735 262	3.90%
BG 2030004118	504 591	2.68%
BG 2040202215	17 237	0.09%
BG 2009794228	652 598	3.46%
BG 2040103215	41 511	0.22%
<i>Общински облигации</i>	<b>313 438</b>	<b>1.66%</b>
BG 2100007041	297 041	1.57%
BG 2100005029	16 397	0.09%
<i>Ипотечни облигации</i>	<b>762 324</b>	<b>4.04%</b>
BG 2100020044	409 647	2.17%
BG 2100008049	352 677	1.87%
<i>Корпоративни ценни книжа</i>	<b>6 195 187</b>	<b>32.84%</b>
BG 2100014054	142 235	0.75%

BG 2100007033	32 181	0.17%
BG 2100032056	144 218	0.76%
BG 2100017040	272 032	1.44%
BG 2100001051	405 810	2.15%
BG 2100006050	477 121	2.53%
BG 2100002034	1 608 074	8.53%
BG 2100007058	929 085	4.93%
BG 2100036057	500 988	2.66%
BG 2100027056	298 962	1.58%
BG 2100014062	301 537	1.60%
BG 2100017065	241 834	1.28%
BG 2100031066	841 110	4.46%
<b>Чуждестранни облигации</b>	<b>362 489</b>	<b>1.92%</b>
XS0239029076	362 489	1.92%
<b>Вземания</b>	<b>904 968</b>	<b>4.80%</b>
<b>Обща сума:</b>	<b>18 862 590</b>	<b>100.00%</b>

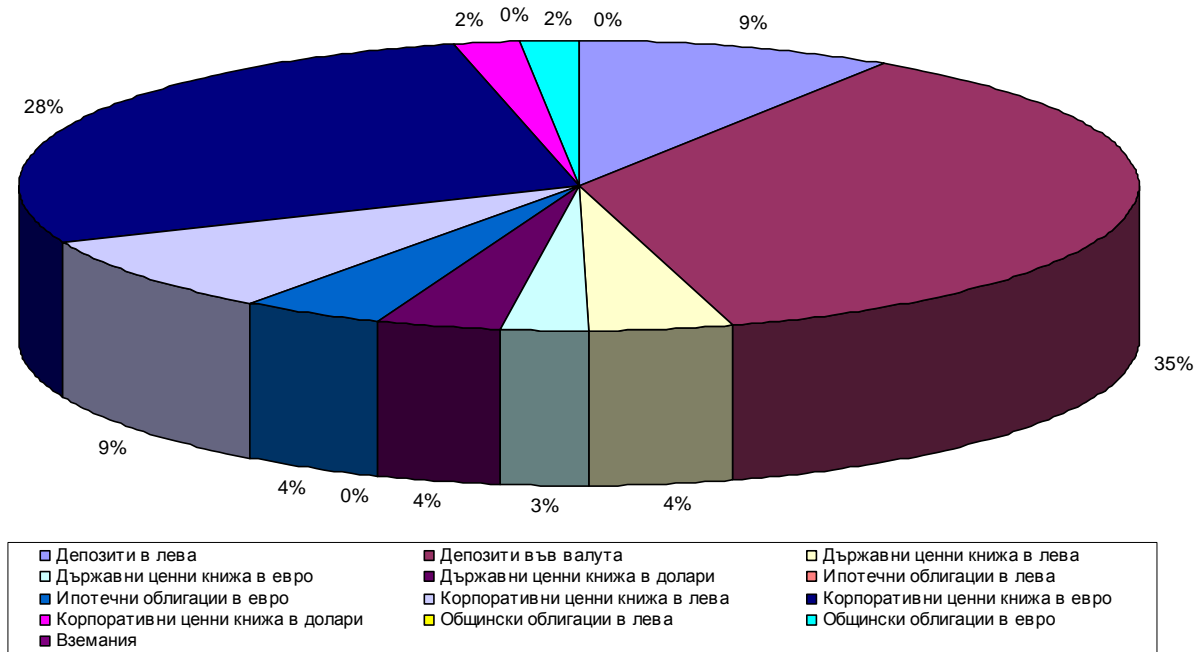
### Разпределение на активите на Ти Би Ай Евробонд към 31/08/2006



Таблицата и графиката по-долу представят обема и структурата на активите към 29.09.2006 г.

<b>Структура на портфейла на Ти Би Ай Евробонд АД към 29/09/2006</b>		
<b>Актив</b>	<b>Стойност в лева</b>	<b>Процент от активите</b>
Парични средства в каса в лева	334	0.00%
Парични средства в разплащателни сметки в лева	98 130	0.53%
Парични средства в разплащателни сметки във валута	1 397	0.01%
Депозити в лева	1 621 815	8.69%
Депозити във валута	6 790 077	36.40%
<b>Дългови ценни книжа</b>		
<i><b>Държавни ценни книжа</b></i>	<b>1 919 996</b>	<b>10.29%</b>
BG 2040099223	488 414	2.62%
BG 2030004118	505 358	2.71%
BG 2040202215	218 235	1.17%
BG 2009794228	666 447	3.57%
BG 2040103215	41 542	0.22%
<i><b>Общински облигации</b></i>	<b>315 005</b>	<b>1.69%</b>
BG 2100007041	298 514	1.60%
BG 2100005029	16 492	0.09%
<i><b>Ипотечни облигации</b></i>	<b>766 151</b>	<b>4.11%</b>
BG 2100020044	411 523	2.21%
BG 2100008049	354 629	1.90%
<i><b>Корпоративни ценни книжа</b></i>	<b>6 765 914</b>	<b>36.27%</b>
BG 2100014054	91 543	0.49%
BG 2100007033	32 390	0.17%
BG 2100032056	267 476	1.43%
BG 2100017040	219 323	1.18%
BG 2100001051	407 843	2.19%
BG 2100006050	479 572	2.57%
BG 2100002034	1 526 375	8.18%
BG 2100007058	818 707	4.39%
BG 2100036057	503 620	2.70%
BG 2100027056	240 465	1.29%
BG 2100014062	600 181	3.22%
BG 2100017065	243 293	1.30%
BG 2100024061	549 035	2.94%
BG 2100031066	786 090	4.21%
<i><b>Чуждестранни облигации</b></i>	<b>374 955</b>	<b>2.01%</b>
XS0239029076	374 955	2.01%
<b>Вземания</b>	<b>708</b>	<b>0.00%</b>
<b>Обща сума:</b>	<b>18 654 481</b>	<b>100.00%</b>

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Евробонд към  
 30/09/2006**



**2 ) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 2: Финансово състояние на другите активи на дружеството в началото и в края на отчетния период**

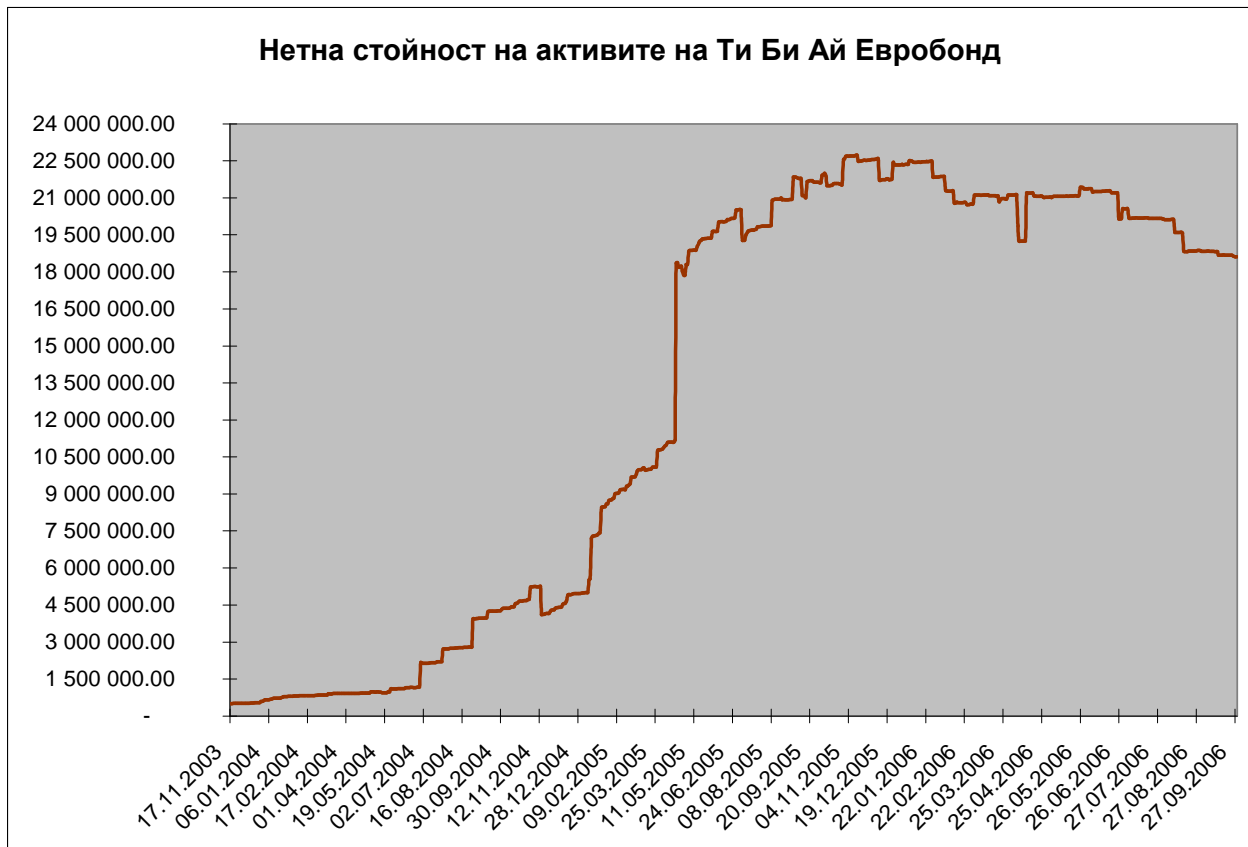
В началото на периода друг актив на дружеството е в размер на 904 968 лв., от които 229 лв. са вземания от доставчици по аванси, 3 013 лв. са свързани с валутна сделка, а 901 726 лв. са вземане от продажба на корпоративни облигации.

Към края на периода друг актив на дружеството е в размер на 708 лв - вземания от доставчици по аванси.

**3 ) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 3: нетна стойност на активите на дружеството в началото и в края на отчетния период; средна месечна стойност на активите**

На 31 август 2006 г. е изчислена НСА в размер на 18 829 988 лв. Към 29 септември НСА е в размер на 18 615 184 лв.

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



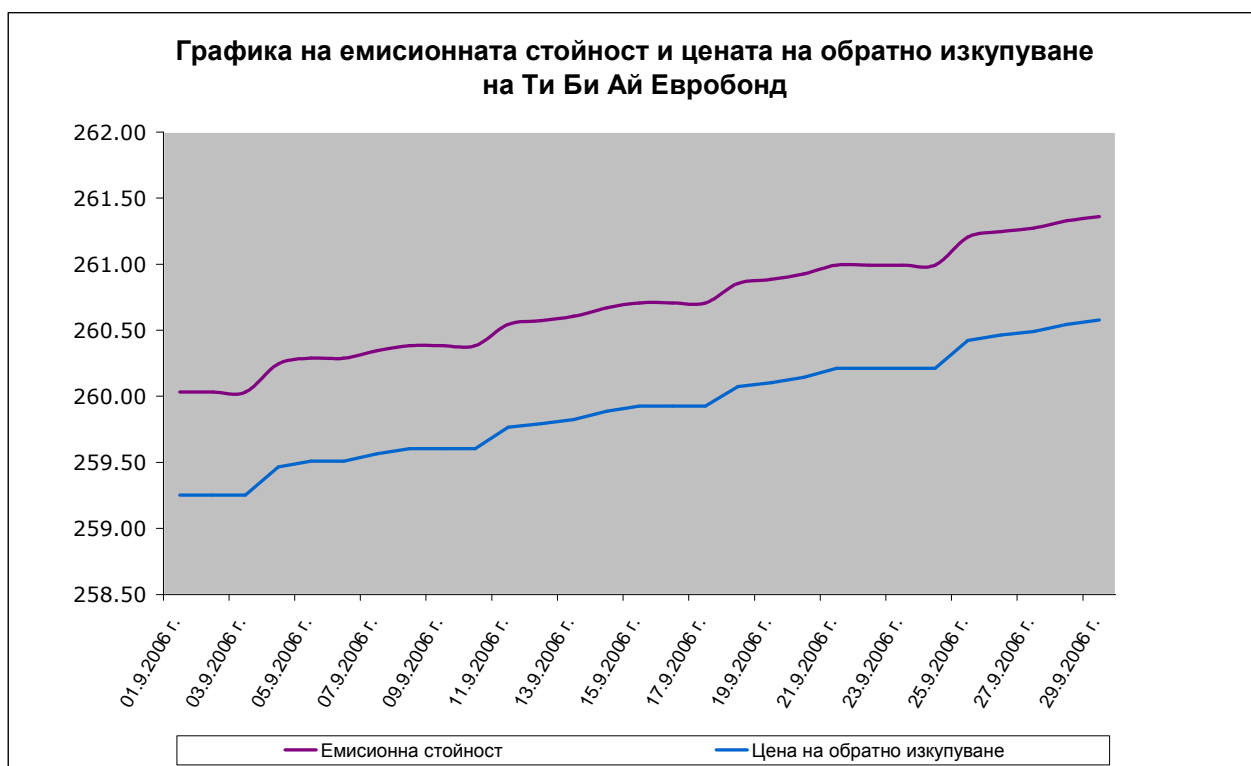
Средната нетна стойност на активите за периода от 01.09.2006 г. до 29.09.2006 г. е 18 733 316 лв., а средногодишната нетна стойност на активите към 29.09.2006 г. е 20 644 711 лв.

**4) 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 акциите на ИД “Ти Би Ай Евробонд” АД за периода 01/09/2006 – 29/09/2006 е представена в таблицата и графиката по-долу:

Дата:	Емисионна стойност:	Цена обратно изкупуване:
29/09/2006	261.3271	260.5443
28/09/2006	261.2727	260.4901
27/09/2006	261.2467	260.4641
26/09/2006	261.2051	260.4227
25/09/2006	260.9937	260.2119
21/09/2006	260.9267	260.1451
20/09/2006	260.8836	260.1022
19/09/2006	260.8546	260.0732
18/09/2006	260.7064	259.9254
15/09/2006	260.6693	259.8885

14/09/2006	260.6049	259.8243
13/09/2006	260.5729	259.7923
12/09/2006	260.5451	259.7647
11/09/2006	260.3830	259.6030
08/09/2006	260.3439	259.5641
07/09/2006	260.2876	259.5080
05/09/2006	260.2462	259.4666
04/09/2006	260.0317	259.2527
01/09/2006	259.9988	259.2200



##### 5 ) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 5: брой и цени на издадените (продадените) акции

През месец септември са записани 13 акции. Таблицата по-долу представя продажбата на акции на ИД “Ти Би Ай Евробонд” АД за септември.

Дата	Операция	Брой акции	Емисионна цена	Сума лв.
27/09/2006 г.	записване	2.00	261.25	522.50
29/09/2006 г.	записване	11.00	261.33	2 874.60

**6 ) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 6: брой и цени на изкупените обратно акции**

През месец септември са изкупени обратно 1 214 акции. Таблицата по-долу представя обратното изкупуване на акции на ИД “Ти Би Ай Евробонд” АД за месец септември.

Дата	Операция	Брой Акции	Цена на обратно изкупуване	Сума лв.
04/09/2006 г.	обратно изкупуване	46.00	259.25	11 925.62
05/09/2006 г.	обратно изкупуване	5.00	259.47	1 297.33
07/09/2006 г.	обратно изкупуване	29.00	259.51	7 525.73
08/09/2006 г.	обратно изкупуване	19.00	259.56	4 931.72
11/09/2006 г.	обратно изкупуване	85.00	259.60	22 066.26
12/09/2006 г.	обратно изкупуване	19.00	259.76	4 935.53
14/09/2006 г.	обратно изкупуване	574.00	259.82	149 139.15
15/09/2006 г.	обратно изкупуване	12.00	259.89	3 118.66
19/09/2006 г.	обратно изкупуване	42.00	260.07	10 923.07
20/09/2006 г.	обратно изкупуване	13.00	260.10	3 381.33
21/09/2006 г.	обратно изкупуване	40.00	260.15	10 405.80
25/09/2006 г.	обратно изкупуване	63.00	260.21	16 393.35
26/09/2006 г.	обратно изкупуване	145.00	260.42	37 761.29
27/09/2006 г.	обратно изкупуване	89.00	260.46	23 181.30
28/09/2006 г.	обратно изкупуване	27.00	260.49	7 033.23
29/09/2006 г.	обратно изкупуване	6.00	260.55	1 563.27

В резултат на посочените по-горе записвания и обратни изкупувания, към 29.09.2006 г. общият брой на акции на дружеството възлиза на 71 331 броя.

**7 ) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 7: сключени сделки с активи на портфейла на инвестиционното дружество**

Следващата таблица представя в обобщен вид хронологията на сделките с активи на ИД “Ти Би Ай Евробонд” АД за отчетния период:

Дата	Вид сделки	Вид ЦК	Общ брой изтъргвани ЦК	Обща стойност на сделките
01/09/2006	покупка	държавни облигации	175 000	200 585.65
01/09/2006	продажба	корпоративни облигации	30 000	59 616.98
01/09/2006	продажба	корпоративни облигации	30 000	59 816.44
01/09/2006	продажба	корпоративни облигации	50 000	51 162.72
01/09/2006	продажба	корпоративни облигации	37 000	53 827.16
01/09/2006	продажба	корпоративни облигации	40 000	55 313.23
01/09/2006	покупка	корпоративни облигации	60 000	121 932.20
01/09/2006	покупка	корпоративни облигации	147 000	293 816.34
04/09/2006	покупка	корпоративни облигации	200 000	201 684.20

04/09/2006	покупка	корпоративни облигации	70 000	70 589.47
07/09/2006	продажба	държавни облигации	99 200	100 000.00
13/09/2006	продажба	корпоративни облигации	87 000	90 927.22
13/09/2006	продажба	корпоративни облигации	43 000	59 587.85
14/09/2006	покупка	държавни облигации	99 200	100 062.23
14/09/2006	продажба	държавни облигации	87 260	100 000.00
21/09/2006	покупка	държавни облигации	87 260	100 060.28
21/09/2006	продажба	държавни облигации	148 514	150 000.00
28/09/2006	покупка	държавни облигации	148 514	150 091.00
28/09/2006	продажба	държавни облигации	129 114	250 000.00

### II. Данни по чл. 18, ал. 3

Обобщена информация за отчетния период и съответните данни за предходните два периода са представени в сравнителна таблица (виж *Приложение I*).

Стоян Тошев

Изпълнителен директор

Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД