

**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 3.67% и 41.75%, от които 2.10% в чуждестранни ценни книжа. Инвестициите в държавни ценни книжа, емитирани по вътрешния дълг на Република България са 11.52% от активите на инвестиционното дружество. Средствата, инвестирани в общински облигации съставляват 1.76% от всички активи. Паричните средства по депозити и разплащателни сметки са 41.26%. Активите, деноминирани във валута са 78.47%. Доходността, постигната от началото на публичното предлагане (17 ноември 2003 г.) е 9.50%<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 30/09/2006 и 31/10/2006 е съответно 18 654 481 лв. и 17 977 866 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.		
	31.08.2006	30.09.2006	31.10.2006
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	772 385	827 147	895 306
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	1 263 257	1 328 136	1 399 348
Заплати, социално и пенсионно осигуряване	11 481	12 987	14 493
Други разходи	2411	2610	2 853

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

Разходи за външни услуги	191 779	210 669	231 062
<b>Общо разходи:</b>	<b>2 241 314</b>	<b>2 381 549</b>	<b>2 543 063</b>

Общият размер на разходите на дружеството към 31/10/2006 г. са 2 543 063 лева, които включват 1 399 348 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 895 306 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 31 октомври – 217 373 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.06%

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

- към 31 октомври – 1 028 лв.

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

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 31 октомври – 2 065 лв.

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

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

- към 31 октомври – 13 642 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.07%

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

- към 31 октомври – 700 лв.

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

е) Други разходи на инвестиционното дружество

- към 31 октомври – 13 601

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.07%

- Други разходи по финансови операции в размер на 1 825 лв.

- Разходи за възнаграждения – 5 463 лв.

- Разходи за външни услуги (КФН, БФБ, ЦД, в-к „Пари”, в-к „Дневник”) – 6 313 лв.

ж) Общ размер на всички разходи по букви а) – е) – 248 409 лв. към месец октомври; като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.22%

Долната таблица представя приходите на Дружеството към 31.08.2006, 30.09.2006 и 31.10.2006 г. Приходите са в размер на 3 489 131 лв, включващи преценка от операции с финансови активи и приходи от лихви.

Приходи	Стойност в лв.		
	31.08.2006	30.09.2006	31.10.2006
Приходи от лихви	992 141	1 098 191	1 214 220
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	1 224 629	1 307 213	1 397 921
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	761 349	810 810	876 990
<b>Общо приходи:</b>	<b>2 978 119</b>	<b>3 216 214</b>	<b>3 489 131</b>

## II. Данни по чл. 18, ал. 2

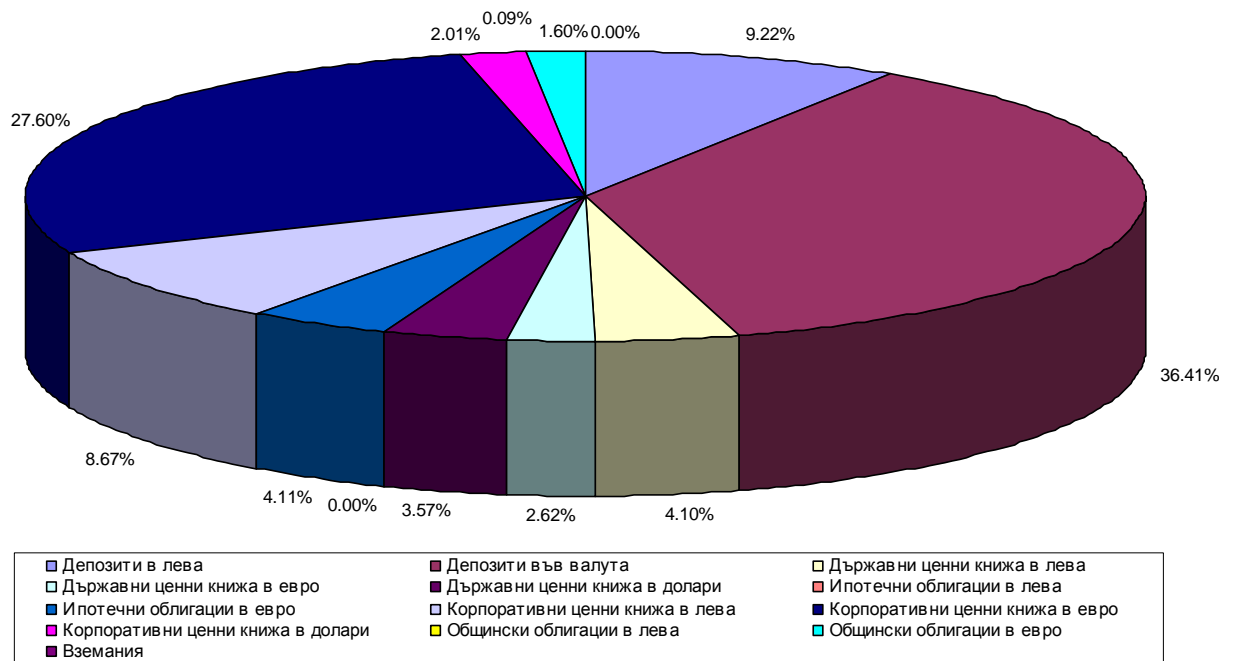
1 ) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 1: *Обем и структурата на инвестициите в портфейла, в т.ч. по отрасли в началото и в края на периода*

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 30/09/2006		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
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%
Дългови ценни книжа		
<i>Държавни ценни книжа</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>Общински облигации</i>	<b>315 005</b>	<b>1.69%</b>
BG 2100007041	298 514	1.60%
BG 2100005029	16 492	0.09%
<i>Ипотечни облигации</i>	<b>766 151</b>	<b>4.11%</b>
BG 2100020044	411 523	2.21%
BG 2100008049	354 629	1.90%
<i>Корпоративни ценни книжа</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%
<b>Чуждестранни облигации</b>	<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>

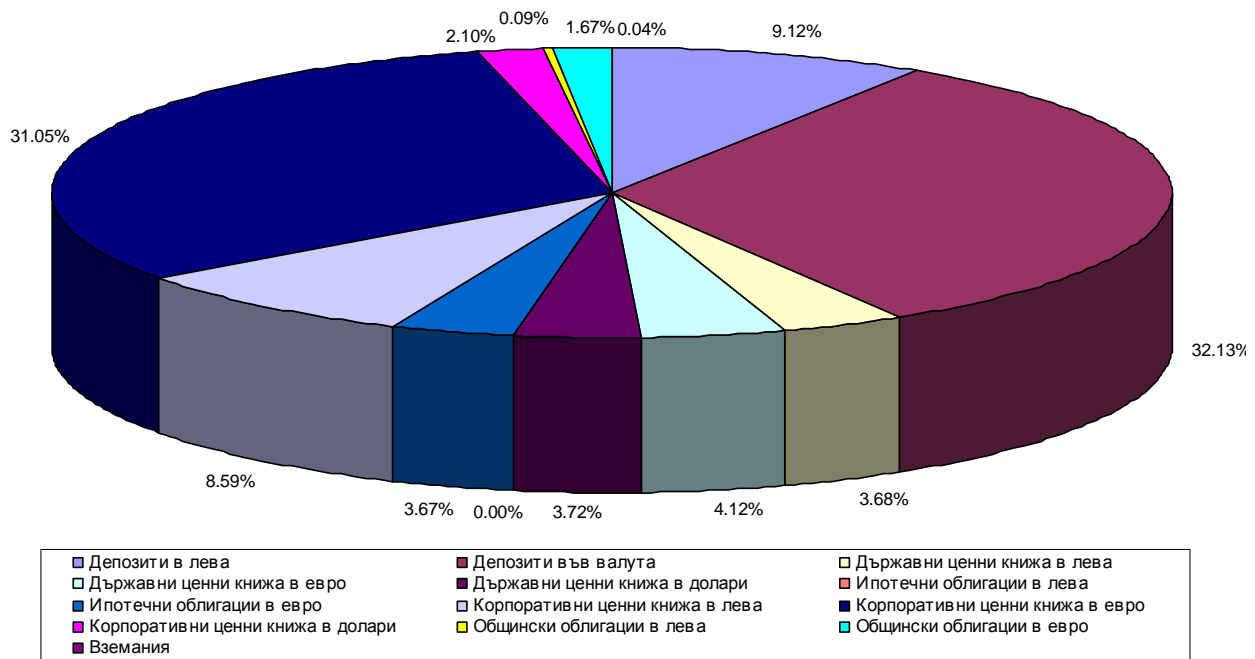
### Разпределение на активите на Ти Би Ай Евробонд към 30/09/2006



Таблицата и графиката по-долу представят обема и структурата на активите към 31.10.2006 г.

<b>Структура на портфейла на Ти Би Ай Евробонд АД към 31/10/2006</b>		
<b>Актив</b>	<b>Стойност в лева</b>	<b>Процент от активите</b>
Парични средства в каса в лева	106	0.00%
Парични средства в разплащателни сметки в лева	8 170	0.05%
Парични средства в разплащателни сметки във валута	1 347	0.01%
Депозити в лева	1 631 837	9.08%
Депозити във валута	5 775 721	32.13%
<b>Дългови ценни книжа</b>		
<i><b>Държавни ценни книжа</b></i>	<b>2 070 514</b>	<b>11.52%</b>
BG 2040099223	741 110	4.12%
BG 2030004118	407 386	2.27%
BG 2040202215	212 036	1.18%
BG 2009794228	668 263	3.72%
BG 2040103215	41 720	0.23%
<i><b>Общински облигации</b></i>	<b>316 771</b>	<b>1.76%</b>
BG 2100007041	300 170	1.67%
BG 2100005029	16 600	0.09%
<i><b>Ипотечни облигации</b></i>	<b>660 114</b>	<b>3.67%</b>
BG 2100020044	304 871	1.70%
BG 2100008049	355 243	1.98%
<i><b>Корпоративни ценни книжа</b></i>	<b>7 127 852</b>	<b>39.65%</b>
BG 2100014054	9 329	0.05%
BG 2100007033	32 586	0.18%
BG 2100032056	269 120	1.50%
BG 2100017040	1 012 031	5.63%
BG 2100001051	410 260	2.28%
BG 2100006050	468 370	2.61%
BG 2100002034	1 535 758	8.54%
BG 2100007058	455 391	2.53%
BG 2100036057	506 537	2.82%
BG 2100027056	339 026	1.89%
BG 2100014062	603 779	3.36%
BG 2100017065	247 667	1.38%
BG 2100024061	447 086	2.49%
BG 2100031066	790 913	4.40%
<i><b>Чуждестранни облигации</b></i>	<b>377 472</b>	<b>2.10%</b>
XS0239029076	377 472	2.10%
<b>Вземания</b>	<b>7 961</b>	<b>0.04%</b>
<b>Обща сума:</b>	<b>17 977 866</b>	<b>100.00%</b>

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Евробонд към  
 31/10/2006**



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

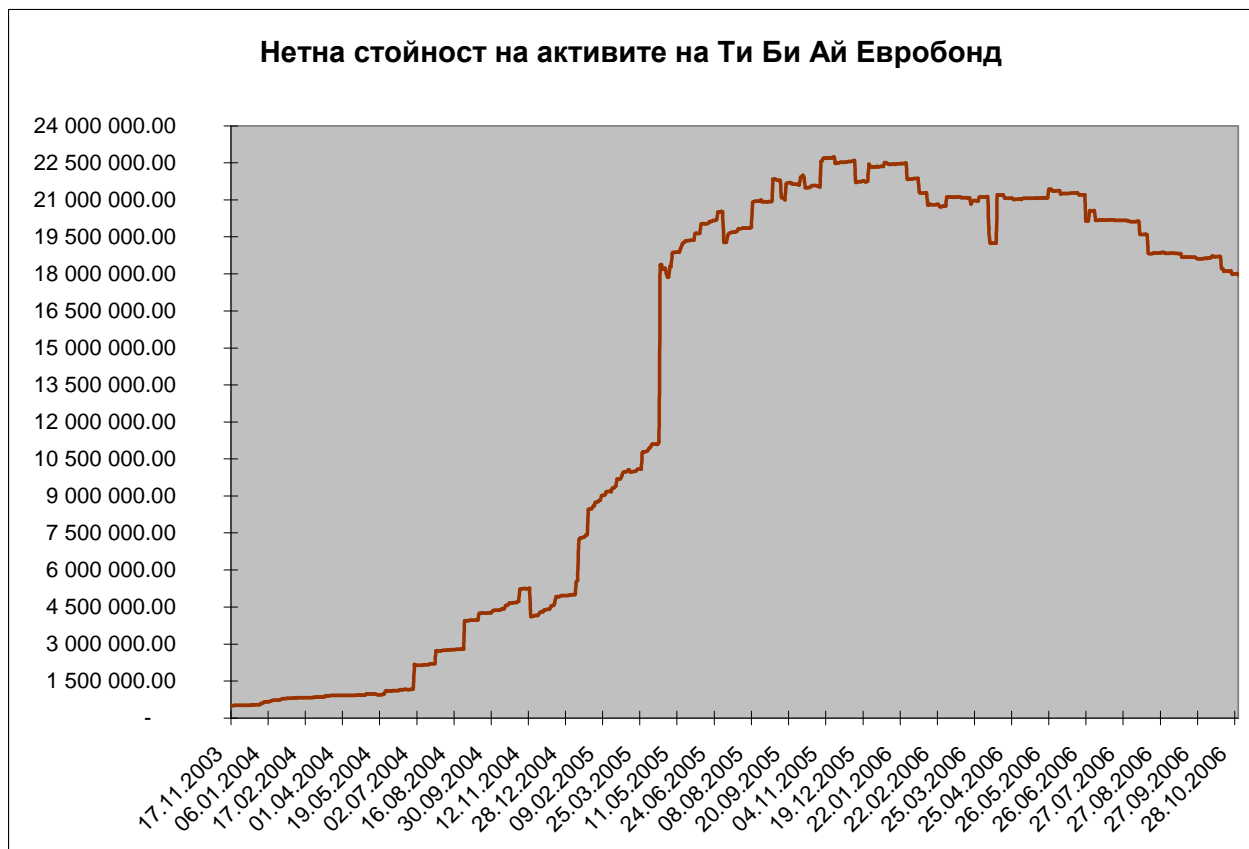
В началото на периода друг актив на дружеството е в размер на 708 лв - вземания от доставчици по аванси.

Към края на периода друг актив на дружеството е в размер на 7 961 лв, от които 523 лв са вземания от доставчици по аванси и 7 438 лв са свързани с валутна сделка.

**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 30 септември 2006 г. е изчислена НСА в размер на 18 615 184 лв. Към 31 октомври НСА е в размер на 17 950 126 лв.

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



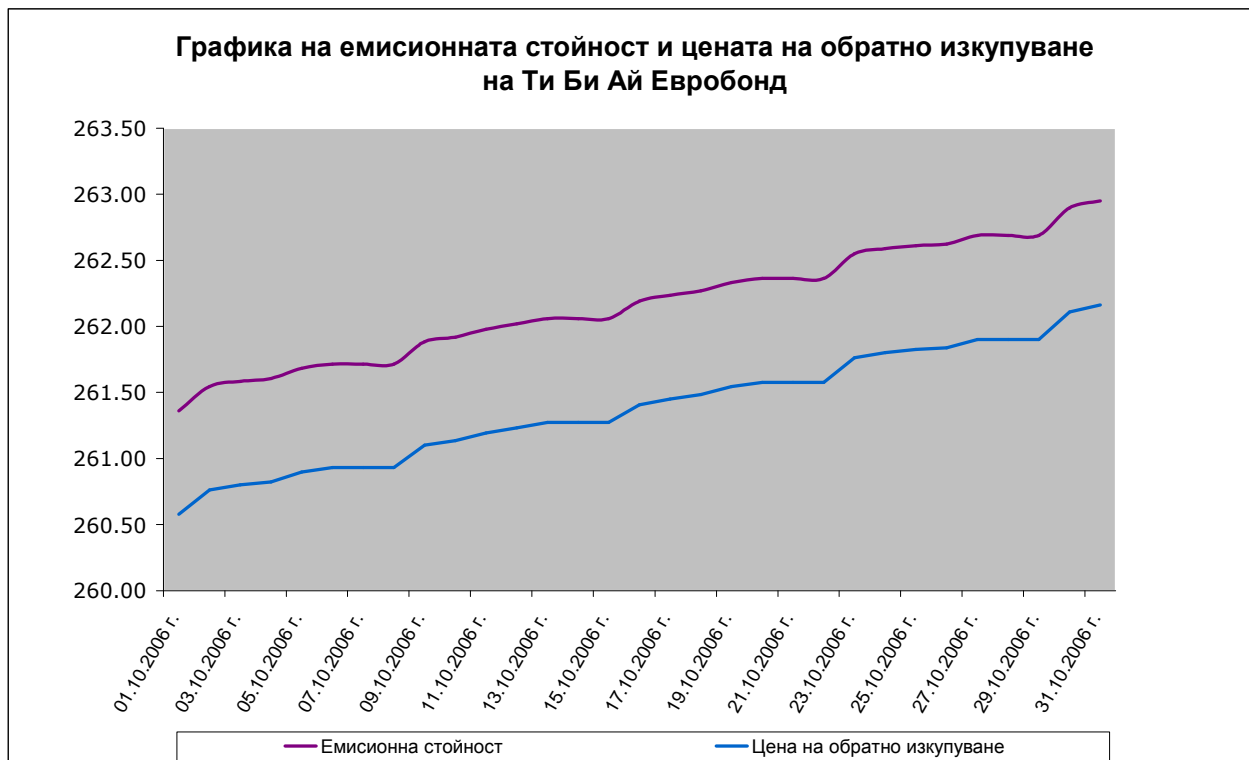
Средната нетна стойност на активите за периода от 01.10.2006 г. до 31.10.2006 г. е 18 383 072 лв., а средногодишната нетна стойност на активите към 31.10.2006 г. е 20 414 084 лв.

**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 01/10/2006 – 31/10/2006 е представена в таблицата и графиката по-долу:

Дата:	Емисионна стойност:	Цена обратно изкупуване:
31/10/2006	262.8973	262.1097
30/10/2006	262.6888	261.9020
27/10/2006	262.6245	261.8379
26/10/2006	262.6117	261.8251
25/10/2006	262.5874	261.8008
24/10/2006	262.5488	261.7624
23/10/2006	262.3619	261.5759
20/10/2006	262.3309	261.5451
19/10/2006	262.2688	261.4832
18/10/2006	262.2362	261.4506

17/10/2006	262.1917	261.4063
16/10/2006	262.0586	261.2736
13/10/2006	262.0179	261.2331
12/10/2006	261.9784	261.1936
11/10/2006	261.9191	261.1345
10/10/2006	261.8842	261.0998
09/10/2006	261.7155	260.9315
06/10/2006	261.6817	260.8979
05/10/2006	261.6056	260.8220
04/10/2006	261.5837	260.8001
03/10/2006	261.5457	260.7623
02/10/2006	261.3606	260.5776



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

През месец октомври са записани 432 акции. Таблицата по-долу представя продажбата на акции на ИД “Ти Би Ай Евробонд” АД за октомври.

Дата	Операция	Брой акции	Емисионна цена	Сума лв.
06/10/2006 г.	записване	137	261.68	35 850.39
09/10/2006 г.	записване	176	261.72	46 061.93
10/10/2006 г.	записване	41	261.88	10 737.25
16/10/2006 г.	записване	3	262.06	786.18
24/10/2006 г.	записване	7	262.55	1 837.84
25/10/2006 г.	записване	68	262.59	17 855.94

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

През месец октомври са изкупени обратно 3 396 акции. Таблицата по-долу представя обратното изкупуване на акции на ИД “Ти Би Ай Евробонд” АД за месец октомври.

Дата	Операция	Брой Акции	Цена на обратно изкупуване	Сума лв.
02/10/2006 г.	обратно изкупуване	4	260.58	1 042.31
05/10/2006 г.	обратно изкупуване	58	260.82	15 127.68
06/10/2006 г.	обратно изкупуване	12	260.90	3 130.77
09/10/2006 г.	обратно изкупуване	8	260.93	2 087.45
11/10/2006 г.	обратно изкупуване	147	261.13	38 386.77
16/10/2006 г.	обратно изкупуване	16	261.27	4 180.38
17/10/2006 г.	обратно изкупуване	1 882	261.41	491 966.65
18/10/2006 г.	обратно изкупуване	1	261.45	261.45
19/10/2006 г.	обратно изкупуване	417	261.48	109 038.49
20/10/2006 г.	обратно изкупуване	3	261.55	784.64
23/10/2006 г.	обратно изкупуване	65	261.58	17 002.43
24/10/2006 г.	обратно изкупуване	52	261.76	13 611.64
26/10/2006 г.	обратно изкупуване	482	261.83	126 199.70
31/10/2006 г.	обратно изкупуване	249	262.11	65 265.32

В резултат на посочените по-горе записвания и обратни изкупувания, към 31.10.2006 г. общият брой на акции на дружеството възлиза на 68 367 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 изтъргувани ЦК	Обща стойност на сделките
05/10/2006	покупка	държавни облигации	129 114	250149.23
05/10/2006	продажба	държавни облигации	197 000	199 265.50
06/10/2006	покупка	държавни облигации	197 000	199 283.38
06/10/2006	продажба	корпоративни облигации	86 000	119 865.44

06/10/2006	продажба	корпоративни облигации	82 000	120 543.26
06/10/2006	продажба	корпоративни облигации	80 000	82 516.18
10/10/2006	продажба	ипотечни облигации	50 000	100 730.38
11/10/2006	покупка	корпоративни облигации	50 000	100 483.05
11/10/2006	продажба	корпоративни облигации	50 000	101 211.83
17/10/2006	продажба	държавни облигации	394 866	400 000.00
19/10/2006	покупка	държавни облигации	394 866	400 074.22
27/10/2006	продажба	държавни облигации	98 570	100 000.00
27/10/2006	покупка	корпоративни облигации	620 000	907 253.20

### 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