

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

ИД ТИ БИ АЙ ЕВРОБОНД АД

I. Данни по чл. 18, ал. 1 от Наредба № 26

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 чуждестранни ценни книжа, деноминирани в долари и са продадени и закупени държавни ценни книжа и корпоративни облигации. Делът на корпоративните облигации е 57.89%, от които 3.66% са чуждестранни ценни книжа. Инвестициите в държавни ценни книжа, емитирани по вътрешния дълг на Република България са 10.31% от активите на инвестиционното дружество. Средствата, инвестирани в общински облигации съставляват 0.24% от всички активи. Паричните средства по депозити и разплащателни сметки са 31.48%. Активите, деноминирани във валута са 77.91%. Доходността, постигната от началото на публичното предлагане (17 ноември 2003 г.) е 8.80%¹.

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

Стойността на портфейла към 31/07/2007 и 31/08/2007 е съответно 18 878 813 лв. и 19 367 116 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.		
	30.06.2007	31.07.2007	31.08.2007
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	279 192	338 991	416 651
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	379 152	442 979	517 516

¹ Доходността е изчислена през нетната стойност на активите на 1 акция за съответните дати.

Заплати, социално и пенсионно осигуряване	9 304	10 852	12 400
Други разходи	2602	3250	3 756
Разходи за външни услуги	130 690	151 601	171 583
Общо разходи:	800 939	947 672	1 121 906

Общият размер на разходите на дружеството към 31/08/2007 г. са 1 121 906 лева, които включват 517 516 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 416 651 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 31 август – 162 144 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.81%

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

- към 31 август – 1 749 лв.

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

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 31 август – 1 640 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 август – 12 970 лв.

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

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

- към 31 август – 560 лв.

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

е) Други разходи на инвестиционното дружество

- към 31 август – 8 676 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.04%

- Други разходи по финансови операции в размер на 2 007 лв.

- Разходи за възнаграждения – 3 749 лв.

- Разходи за външни услуги (КФН, БФБ, ЦД) – 2 920 лв.

ж) Общ размер на всички разходи по букви а) – е) – 187 739 лв. към месец август; като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.93%

Долната таблица представя приходите на Дружеството към 30.06.2007, 31.07.2007 и 31.08.2007 г. Приходите са в размер на 1 920 378 лв, включващи преценка от операции с финансови активи и приходи от лихви.

Приходи	Стойност в лв.		
	30.06.2007	31.07.2007	31.08.2007
Приходи от лихви	728 820	845 873	955 629
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	411 342	478 630	559 534
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	270 434	328 797	405 215
Общо приходи:	1 410 597	1 653 301	1 920 378

II. Данни по чл. 18, ал. 2 от Наредба № 26

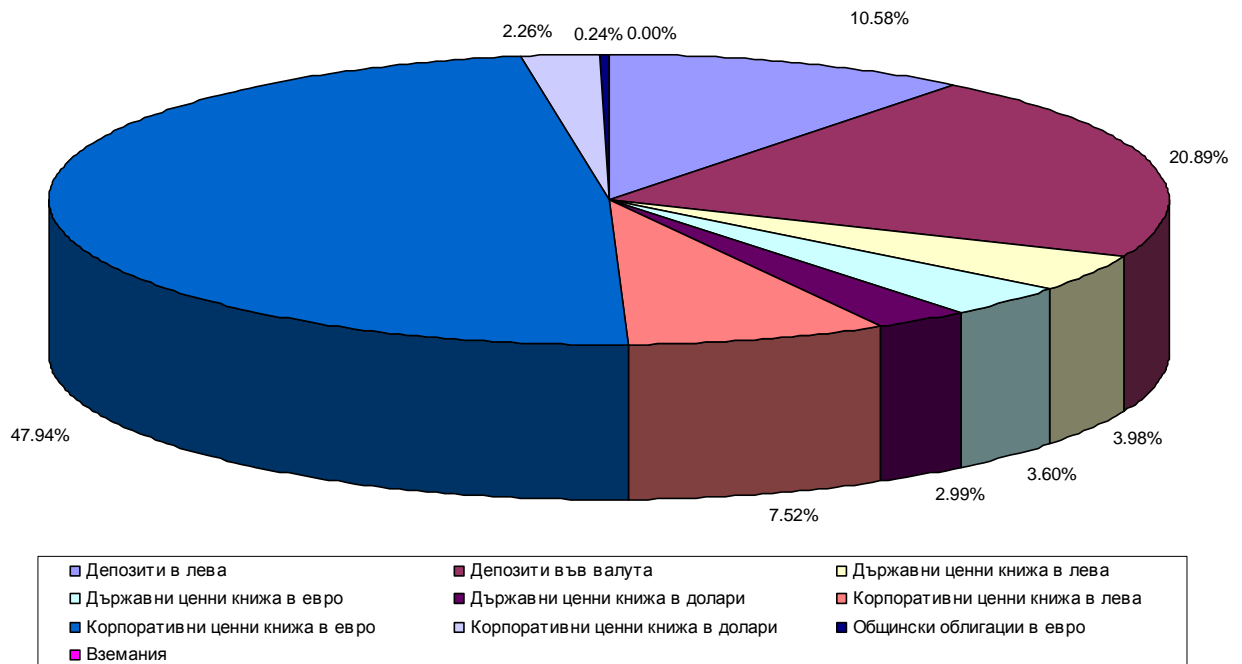
1) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 1: *Обем и структурата на инвестициите в портфейла, в т.ч. по отрасли в началото и в края на периода*

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 31/07/2007		
Актив	Стойност в лева	Процент от активите
Парични средства в каса в лева	269	0.00%
Парични средства в разплащателни сметки в лева	51 899	0.27%
Парични средства в разплащателни сметки във валута	641	0.00%
Депозити в лева	1 944 714	10.30%
Депозити във валута	3 942 471	20.88%
Дългови ценни книжа		
Държавни ценни книжа	1 995 813	10.57%
BG 2040099223	679 770	3.60%
BG 2030004118	498 795	2.64%
BG 2040202215	211 313	1.12%
BG 2009794228	564 173	2.99%
BG 2040103215	41 761	0.22%
Общински облигации	46 137	0.24%
BG 2100003057	46 137	0.24%
Корпоративни ценни книжа	10 470 688	55.46%
BG 2100014054	876 679	4.64%
BG 2100007033	23 871	0.13%
BG 2100032056	282 354	1.50%
BG 2100017040	672 698	3.56%
BG 2100001051	398 111	2.11%

BG 2100006050	473 650	2.51%
BG 2100002034	543 325	2.88%
BG 2100007074	824 529	4.37%
BG 2100027056	339 784	1.80%
BG 2100014062	911 322	4.83%
BG 2100017065	243 579	1.29%
BG 2100024061	886 935	4.70%
BG 2100031066	577 542	3.06%
BG 2100037063	284 380	1.51%
BG 2100022040	29 980	0.16%
BG 2100019061	406 966	2.16%
BG 2100036057	610 243	3.23%
BG 2100001077	863 679	4.57%
BG 2100030068	332 152	1.76%
BG 2100010078	888 908	4.71%
Чуждестранни облигации	425 872	2.26%
XS0254845844	138 584	0.73%
XS0301590047	287 288	1.52%
Вземания	310	0.00%
Обща сума:	18 878 813	100.00%

Разпределение на активите на Ти Би Ай Евробонд към 31/07/2007

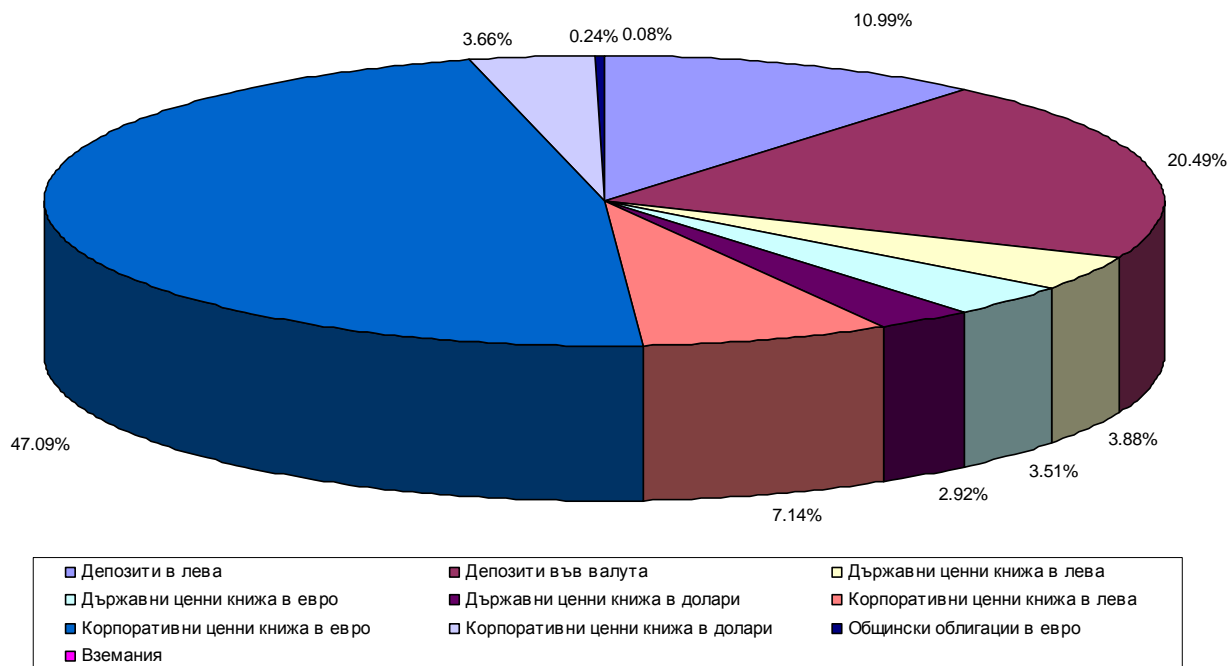


Таблицата и графиката по-долу представят обема и структурата на активите към 31.08.2007 г.

Структура на портфейла на Ти Би Ай Евробонд АД към 31/08/2007		
Актив	Стойност на актив	Процент от активите
1. Парични средства в каса в лева	479	0.00%
2. Парични средства в разплащателни сметки в лева	80 240	0.41%
3. Парични средства в разплащателни сметки във валута	772	0.00%
4. Депозит в лева	2 047 801	10.57%
5. Депозит във валута	3 967 212	20.48%
6. Дългови ценни книжа		
Държавни ценни книжа	1 995 991	10.31%
BG2030004118	499 641	2.58%
BG2040202215	210 624	1.09%
BG2040103215	40 591	0.21%
BG2040099223	680 038	3.51%
BG2009794228	565 097	2.92%
Общински облигации	46 408	0.24%
BG2100003057	46 408	0.24%
Корпоративни ценни книжа	10 502 297	54.23%
BG2100002034	501 051	2.59%
BG2100014054	881 780	4.55%
BG2100024061	892 490	4.61%
BG2100007033	24 005	0.12%
BG2100032056	282 721	1.46%
BG2100030068	327 363	1.69%
BG2100001051	220 232	1.14%
BG2100006050	476 401	2.46%
BG2100027056	341 863	1.77%
BG2100014062	916 997	4.73%
BG2100017065	245 080	1.27%
BG2100010078	894 524	4.62%
BG2100037063	286 293	1.48%
BG2100022040	30 146	0.16%
BG2100007074	760 524	3.93%
BG2100036057	613 996	3.17%
BG2100001077	837 272	4.32%
BG2100031066	569 309	2.94%
BG2100017040	588 078	3.04%
BG2100019061	409 506	2.11%
BG2100016075	402 666	2.08%
Чуждестранни облигации	709 490	3.66%
XS0301590047	285 504	1.47%
XS0254845844	130 612	0.67%

XS0304994337	293 375	1.51%
7. Вземания	16 426	0.08%
Общо активи:	19 367 116	100.00%

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Евробонд към
31/08/2007**



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 310 лв, които са вземания от доставчици по аванси.

Към края на периода друг актив на дружеството е в размер на 16 426 лв, от които 230 лв. са вземания от доставчици по аванси и 16 196 лв. са от 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 31 юли 2007 г. е изчислена НСА в размер на 18 763 589 лв. Към 31 август НСА е в размер на 19 335 643 лв.

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



Средната нетна стойност на активите за периода от 01.08.2007 г. до 31.08.2007 г. е 18 276 969 лв., а средногодишната нетна стойност на активите към 31.08.2007 г. е 20 104 264 лв.

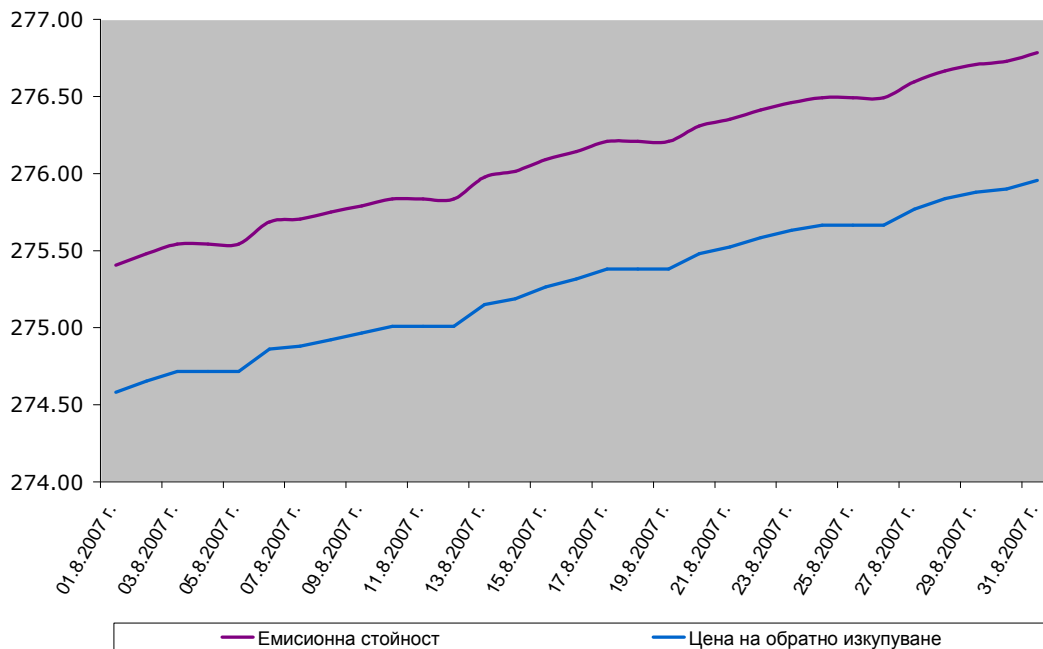
4) Данни по чл. 18, ал. 2 т. 4: данни за обявените емисионна стойност и цена на обратно изкупуване и датите на тяхното обявяване

Динамиката на емисионната стойност и цената на обратно изкупуване на акциите на ИД “Ти Би Ай Евробонд” АД за периода 01/08/2007 – 31/08/2007 е представена в таблицата и графиката по-долу:

Дата:	Емисионна стойност:	Цена обратно изкупуване:
31/08/2007	276.7278	275.8988
30/08/2007	276.7064	275.8776
29/08/2007	276.6656	275.8368
28/08/2007	276.5959	275.7673

27/08/2007	276.4924	275.6642
24/08/2007	276.4599	275.6317
23/08/2007	276.4111	275.5831
22/08/2007	276.3513	275.5235
21/08/2007	276.3074	275.4798
20/08/2007	276.2074	275.3800
17/08/2007	276.1419	275.3147
16/08/2007	276.0904	275.2634
15/08/2007	276.0146	275.1878
14/08/2007	275.9771	275.1505
13/08/2007	275.8343	275.0081
10/08/2007	275.7906	274.9644
09/08/2007	275.7482	274.9222
08/08/2007	275.7043	274.8785
07/08/2007	275.6859	274.8601
06/08/2007	275.5419	274.7165
03/08/2007	275.4789	274.6537
02/08/2007	275.4056	274.5806
01/08/2007	275.3826	274.5576

Графика на емисионната стойност и цената на обратно изкупуване на Ти Би Ай Евробонд



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

През месец август са записани 5 578 акции. Таблицата по-долу представя продажбата на акции на ИД “Ти Би Ай Евробонд” АД за август.

Дата	Операция	Брой акции	Емисионна цена	Сума лв.
13/08/2007	записване	145	275.83	39 995.97
24/08/2007	записване	10	276.46	2 764.60
28/08/2007	записване	5 423.00	276.60	1 499 979.57

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

През месец август са изкупени обратно 4 132 акции. Таблицата по-долу представя обратното изкупуване на акции на ИД “Ти Би Ай Евробонд” АД за месец август.

Дата	Операция	Брой Акции	Цена на обратно изкупуване	Сума лв.
02/08/2007	обратно изкупуване	37	274.58	10 159.48
03/08/2007	обратно изкупуване	6	274.65	1 647.92
08/08/2007	обратно изкупуване	132	274.88	36 283.96
09/08/2007	обратно изкупуване	3 800.00	274.92	1 044 704.36
10/08/2007	обратно изкупуване	7	274.96	1 924.75
13/08/2007	обратно изкупуване	4	275.01	1 100.03
15/08/2007	обратно изкупуване	68	275.19	18 712.77
27/08/2007	обратно изкупуване	3	275.66	826.99
30/08/2007	обратно изкупуване	75	275.88	20 690.82

В резултат на посочените по-горе записвания и обратни изкупувания, към 31.08.2007 г. общият брой на акции на дружеството възлиза на 69 963 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
02/08/2007	покупка	чуждестранни облигации	150 000	150 150

02/08/2007	покупка	корпоративни облигации	200 000	391 838.92
09/08/2007	продажба	държавни облигации	350 000	350 000
14/08/2007	продажба	корпоративни облигации	90 000	179 611.51
14/08/2007	продажба	корпоративни облигации	18 000	19 134.70
16/08/2007	покупка	държавни облигации	350 000	350 313.07
16/08/2007	продажба	държавни облигации	135 000	150 525.00
23/08/2007	покупка	държавни облигации	135 000	150 656.71
29/08/2007	продажба	корпоративни облигации	35 000	69 079.05
29/08/2007	продажба	корпоративни облигации	2 000	2 035.41

III. Данни по чл. 18, ал. 3 от Наредба № 26

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

IV. Данни по чл. 48, ал. 3, т. 2 от Наредба № 25

Във връзка с притежаваните от инвестиционното дружество валутно деноминирани активи, управляващото дружество извършва хеджиращи сделки с цел предпазване от валутния риск, на който е изложено дружеството. Хеджираните активи и сключените сделки са описани по-долу.

Рисков актив

ISIN	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
BG2009794228	USD	400 000.01	98.995	\$395 978.33
XS0301590047	USD	200 000.00	100.030	\$200 060.00
XS0254845844	USD	100 000.00	91.523	\$91 523.20

Обща рискова позиция	\$687 561.53
-----------------------------	---------------------

Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърдна покупка	EUR/USD	€ 523 000.00	1.34880	\$705 422.40	OTC	България

Обща хеджираща позиция	\$705 422.40
-------------------------------	---------------------

Стоян Тошев

Изпълнителен директор

Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД