



Асет Менџмънт

**ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО
ЧЛ. 73(1) Т.5 ОТ НАРЕДБА № 44 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА
КОЛЕКТИВНИТЕ ИНВЕСТИЦИОННИ СХЕМИ, УПРАВЛЯВАЩИТЕ
ДРУЖЕСТВА, ИНВЕСТИЦИОННИТЕ ДРУЖЕСТВА ОТ ЗАТВОРЕН ТИП
ИНВЕСТИЦИОННО ДРУЖЕСТВО „ТИ БИ АЙ ЕВРОБОНД”**

I. Данни по чл. 73, ал. 1, т. 5 от Наредба № 44

- 1) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б „г”: Промени в структурата на портфейла през отчетния период

Съгласно инвестиционната политика и стратегия на ИД за инвестиране в дългови ценни книжа, търгувани на регулираните пазари в страната и чужбина през периода са продадени корпоративни облигации, деноминирани в евро. Делът на корпоративните облигации е 24.43% от портфейла на дружеството. Средствата, инвестирани в ипотечни облигации съставляват 3.12% от всички активи. Паричните средства по депозити и разплащателни сметки са 12.71%. Активите, деноминирани във валута са 39.49%. Доходността, постигната от началото на публичното предлагане (17 ноември 2003 г.) е 5.61%¹, доходността за последните 12 месеца е -0.16%, а доходността от началото на годината е -0.16%.

- 2) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б. „а” и „д”: Промени в състоянието на активите в рамките на отчетния период

Долната таблица представя приходите на Дружеството към 31.12.2011 г. Приходите са в размер на 119 027 лева, включващи преоценка от операции с финансови активи, приходи от лихви, положителни курсови разлики и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лв.		
	30.06.2011	30.09.2011	31.12.2011
Приходи от лихви	74,348	86,764	92,334
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	21,219	26,111	26,551
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	61	82	88
Други приходи от финансови операции	42	53	54
Общо приходи:	95,670	113,010	119,027

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



Асет Мениджмънт

Разходите на Дружеството за отчетния период са представени в таблицата по-долу:

Разходи	Стойност в лв.		
	30.06.2011	30.09.2011	31.12.2011
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	321	417	437
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	19,998	37,460	38,628
Заплати, социално и пенсионно осигуряване	6,650	10,861	15,782
Други разходи	1,625	2,315	2,701
Разходи за външни услуги	24,144	30,649	33,938
Общо разходи:	52,738	81,702	91,486

Общият размер на разходите на дружеството към 31/12/2011 г. е 91 486 лева, които включват 38 628 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 437 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 31 декември – 20 418 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.14%

б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява

инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество

- към 31 декември – 650 лв.

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

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 31 декември – 2 614 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.15%

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

- към 31 декември – 15 957 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.89%

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

- към 31 декември – 1 200 лв.

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

е) Други разходи на инвестиционното дружество

- към 31 декември – 11 582 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.65%

- Други разходи по финансови операции в размер на 2 051 лв.

- Разходи за възнаграждения – 5 283 лв.

- Разходи за външни услуги (КФН, БФБ, ЦД) – 4 248 лв.

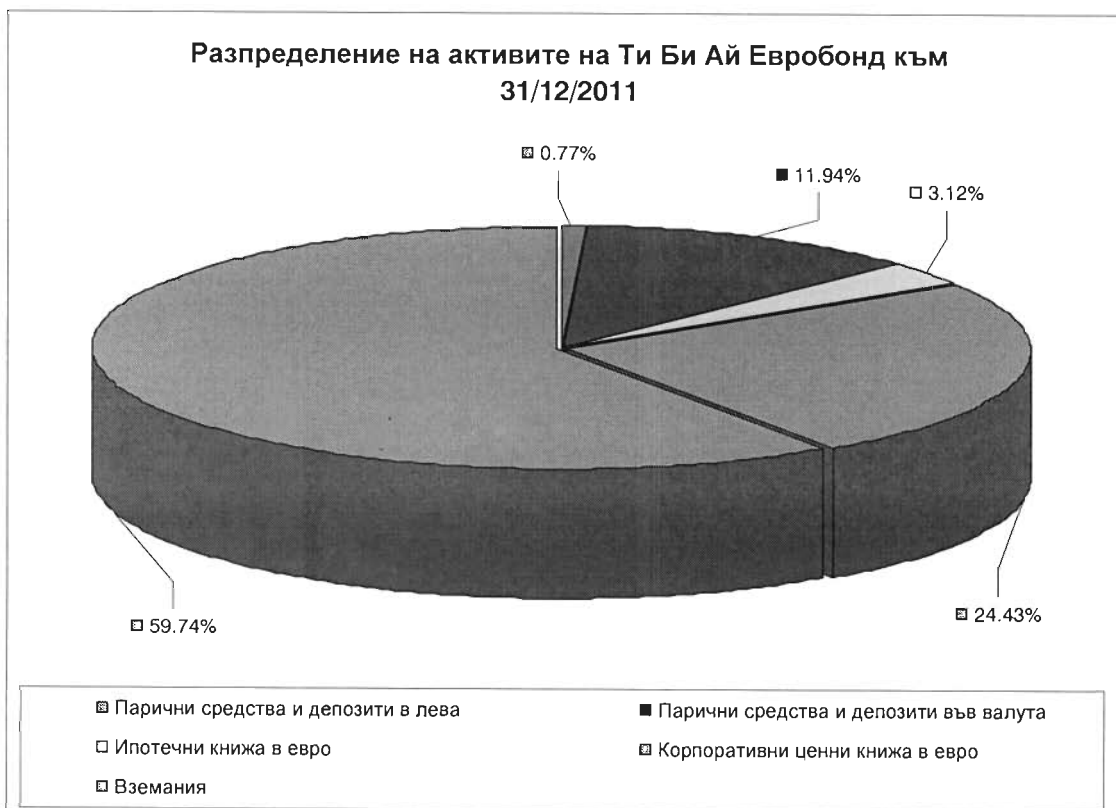
ж) Общ размер на всички разходи по букви а) – е) – 52 421 лв. към месец декември; като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 2.92%.

За периода не са записани нови акции и са изкупени обратно 13 952 броя акции. НСА на Дружеството към 30.06.2011 г. е 1 616 860 лв., към 30.09.2011 г. 768 060 лв., а към 31.12.2011 г. - 743 290 лв. Броят акции към края на отчетния период е 2 375.

3) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б. „в“: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

Структурата на портфейла на Ти Би Ай Евробонд в края на периода е представена в следната таблица и графика.

Актив	Процент от активите	Стойност в лева
Парични средства и депозити в лева	0.77%	5,822
Парични средства и депозити във валута	11.94%	90,036
Ипотечни книжа в евро	3.12%	23,515
Корпоративни ценни книжа в евро	24.43%	184,200
Вземания	59.74%	450,350
Total:	100.00%	753,923



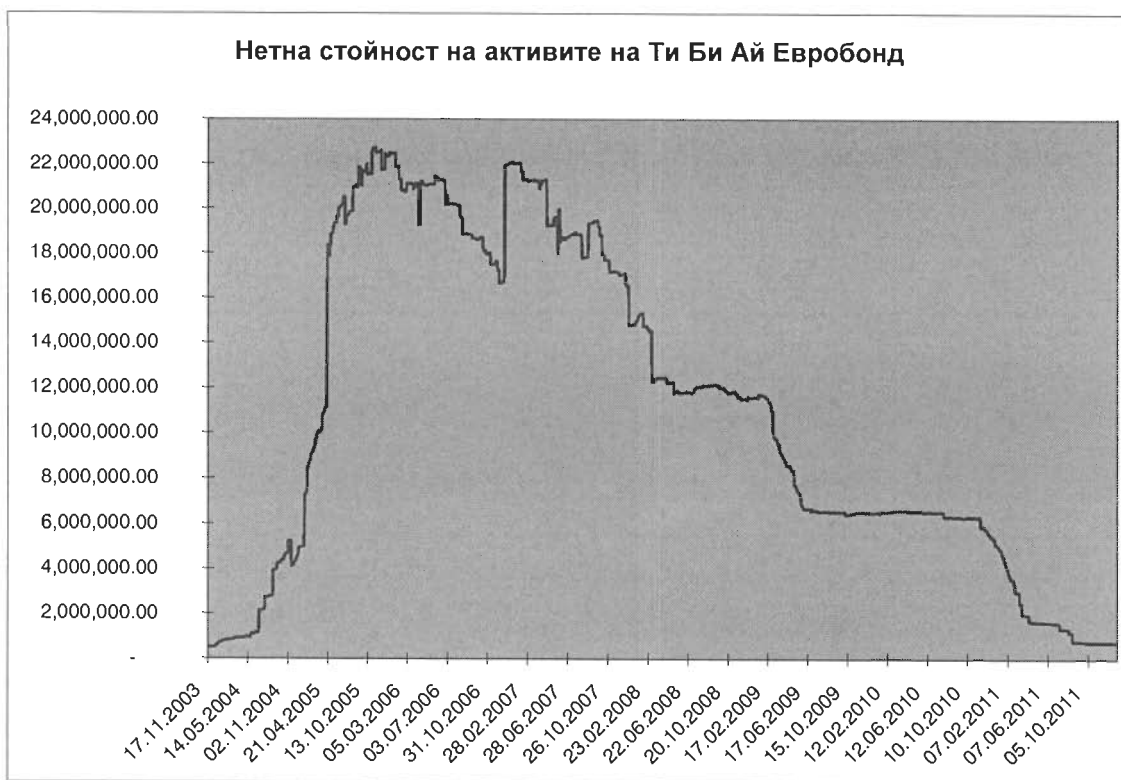


Асет Мениджмънт

4) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б. „б“: Нетна стойност на активите на една акция

На 30.06.2011 г. е изчислена нетна стойност на активите на една акция в размер на 317.5294 лв. Към 30.09.2011 г. нетната стойност на активите на една акция е 314.5210 лв., а към 31.12.2011 г. нетната стойност на активите на една акция е 312.9642 лв.

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



5) Данни по чл. 73, ал. 1 т. 5, б. „е“: Сравнителна таблица за последните три финансови години, включваща общата стойност на нетните активи и нетна стойност на една акция

	Към 31 декември 2009 (лв)	Към 31 декември 2010 (лв)	Към 31 декември 2011 (лв)
Нетна стойност на активите на ИД "Ти Би Ай Евробонд" АД	6,504,913	5,117,810	743,290
Нетна стойност на активите на акция	312.08	313.46	312.96



Асет Мениджмънт

б) Дани по чл. 73г, ал. 1 т. 5, б. „ж“: Задължения, възникнали от сделки с деривативни инструменти

Към 31.12.2011 г. ИД Ти Би Ай Евробонд няма сключени сделки с деривативни инструменти и съответно задължения възникнали по такива сделки.

Мирослав Маринов

Изпълнителен директор

Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

