

ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО ИЗИСКВАНИЯТА НА ЧЛ. 18 ОТ НАРЕДБА № 26 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА УПРАВЛЯВАЩИТЕ ДРУЖЕСТВА

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*

През периода са закупени корпоративни облигации, деноминирани в евро. Делът на ипотечните и корпоративни облигации е съответно 3.77% и 42.74%, от които 1.79% в чуждестранни ценни книжа. Инвестициите в държавни ценни книжа, емитирани по вътрешния дълг на Република България са 9.70% от активите на инвестиционното дружество. Средствата, инвестирани в общински облигации съставляват 1.50% от всички активи. Паричните средства по депозити и разплащателни сметки са 40.27%. Активите, деноминирани във валута са 72.67%. Доходността, постигната от началото на публичното предлагане (17 ноември 2003 г.) е 10.00%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 30/04/2006 и 31/05/2006 е съответно 21 025 239 лв. и 21 368 211 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.		
	31.03.2006	30.04.2006	31.05.2006
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	283 235	375 765	492 557
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	638 419	804 024	905 228
Заплати, социално и пенсионно осигуряване	4 309	5 749	7 189
Други разходи	260	1 194	1 238
Разходи за външни услуги	82 116	102 309	126 304
Общо разходи:	1 008 339	1 289 041	1 532 517

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

Общият размер на разходите на дружеството към 31/05/2006 г. са 1 532 517 лева, които включват 492 557 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове и 905 228 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти. Последните не са част от “всички разходи, свързани с дейността на дружеството” по чл. 171 ЗППЦК.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество по т. 19
 - към 31 май – 118 872 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.56%

- б) Платените комисионни на инвестиционния посредник по т. 21, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество
 - към 31 май – 55 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.00%

- в) Възнаграждение на банката депозитар по т. 23
 - към 31 май – 1 031 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.005%

- г) Възнаграждение на членовете на управителните и на контролните органи на дружеството
 - към 31 май – 6 671 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.03%

- д) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие
 - към 31 май – 350 лв.
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.002%

- е) Други разходи на инвестиционното дружество
 - към 31 май – 7 753
 - като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.04%

 - Други разходи по финансови операции в размер на 1 183 лв.
 - Разходи за възнаграждения – 2 730 лв.
 - Разходи за външни услуги (КФН, БФБ, ЦД, в-к „Пари”, в-к „Дневник”) – 3 840 лв.

- ж) Общ размер на всички разходи по букви а) – е) – 134 732 лв. към месец май; като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.63%

Долната таблица представя приходите на Дружеството към 31.03.2006, 30.04.2006 и 31.05.2006 г. Приходите са в размер на 1 965 980 лв, включващи преценка от операции с финансови активи и приходи от лихви.

Приходи	Стойност в лв.		
	31.03.2006	30.04.2006	31.05.2006
Приходи от лихви	379 926	491 010	627 158
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	607 670	768 856	860 407
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	276 655	363 159	478 415
Общо приходи:	1 264 251	1 623 025	1 965 980

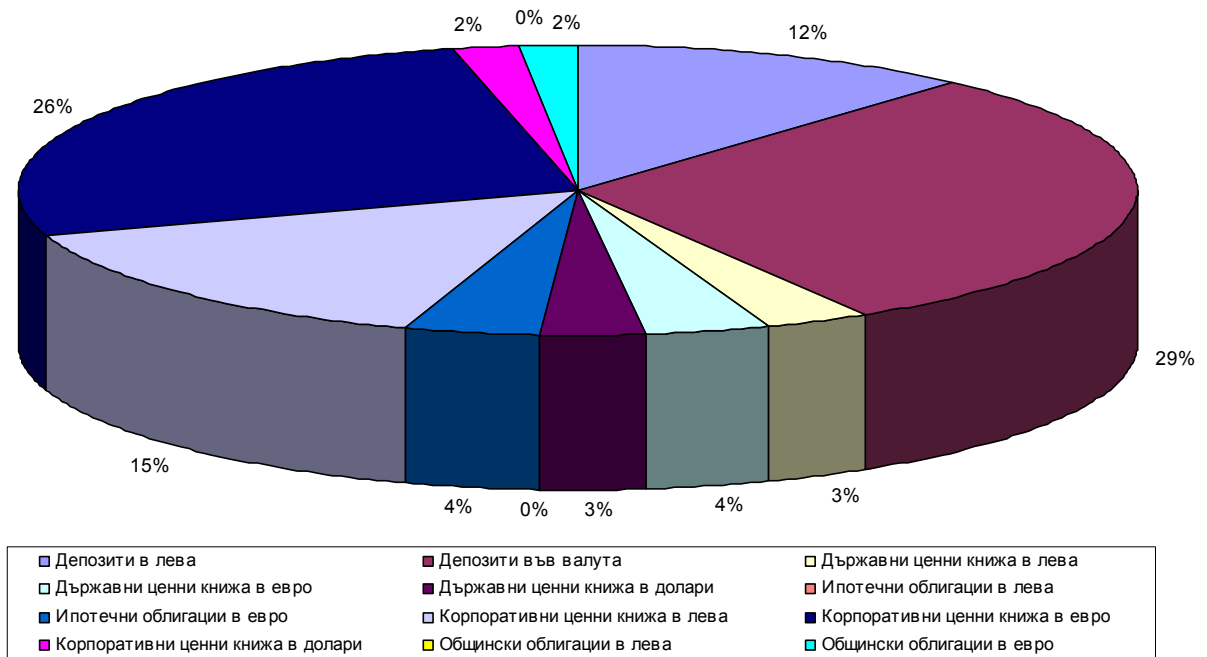
II. Данни по чл. 18, ал. 2

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*

Таблицата и графиката по-долу представят обема и структурата на активите към 30.04.2006 г.

Структура на портфейла на Ти Би Ай Евробонд АД към 31/03/2006		
Актив	Процент от активите	Стойност в лева
Депозити в лева	11.73%	2 465 358.70
Депозити във валута	29.53%	6 208 440.79
Държавни ценни книжа в лева	3.18%	668 077.95
Държавни ценни книжа в евро	3.54%	744 695.42
Държавни ценни книжа в долари	3.23%	679 607.24
Ипотечни облигации в евро	3.81%	801 223.41
Корпоративни ценни книжа в лева	14.84%	3 119 577.95
Корпоративни ценни книжа в евро	26.47%	5 565 841.64
Корпоративни ценни книжа в долари	1.86%	391 715.55
Общински облигации в лева	0.08%	16 661.79
Общински облигации в евро	1.67%	350 385.79
Total:	100.00%	21 025 239.18

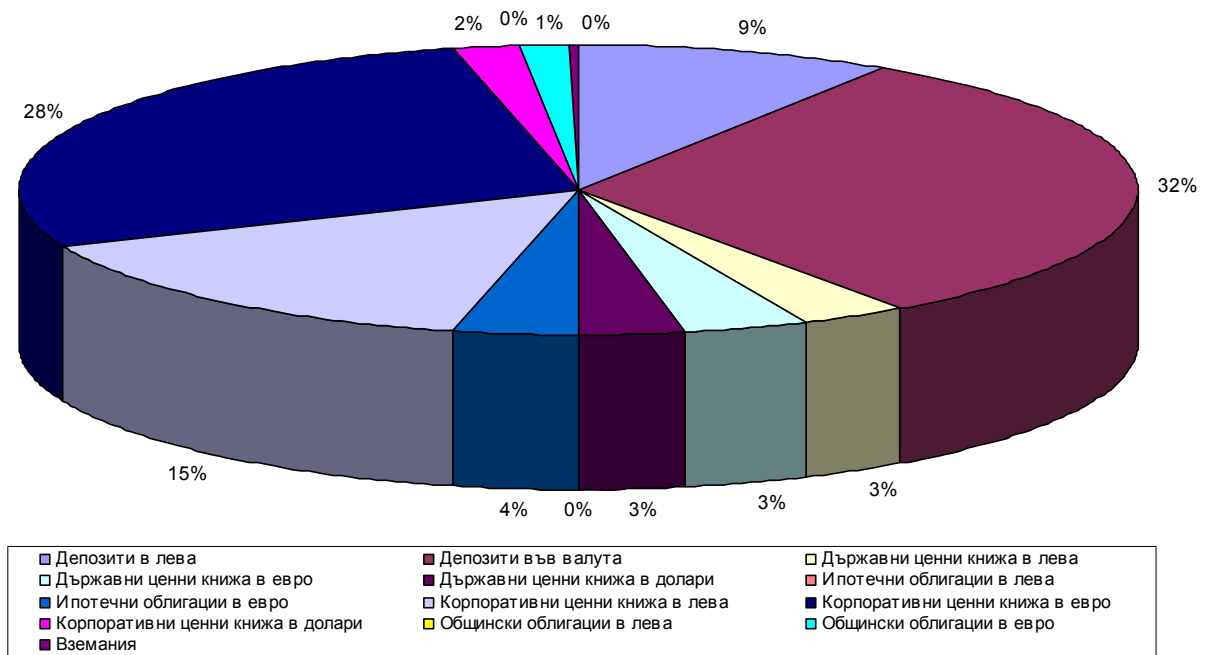
Разпределение на активите на Ти Би Ай Евробонд към 30/04/2006



Таблицата и графиката по-долу представят обема и структурата на активите към 31.05.2006 г.

Структура на портфейла на Ти Би Ай Евробонд АД към 31/05/2006		
Актив	Процент от активите	Стойност в лева
Депозити в лева	9.15%	1 955 402.32
Депозити във валута	31.12%	6 650 175.51
Държавни ценни книжа в лева	3.11%	664 699.34
Държавни ценни книжа в евро	3.49%	744 778.95
Държавни ценни книжа в долари	3.10%	663 043.09
Ипотечни облигации в евро	3.77%	805 621.65
Корпоративни ценни книжа в лева	14.76%	3 155 004.13
Корпоративни ценни книжа в евро	27.98%	5 978 048.84
Корпоративни ценни книжа в долари	1.79%	381 993.90
Общински облигации в лева	0.08%	16 782.58
Общински облигации в евро	1.42%	303 671.26
Вземания	0.23%	48 989.54
Total:	100.00%	21 368 211.11

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Евробонд към
31/05/2006**



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

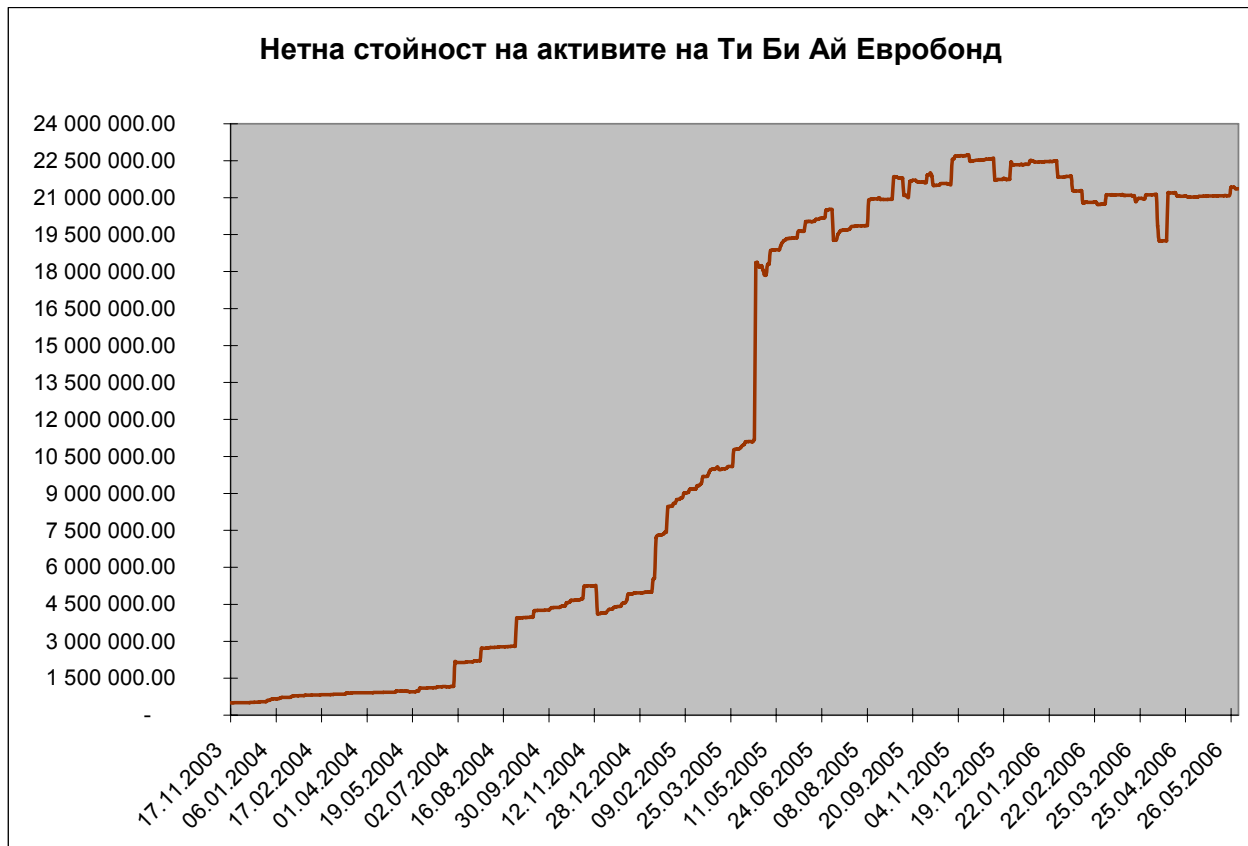
В началото на периода, друг актив на дружеството е в размер на 13 488 лв., от които 844 са вземания от доставчици по аванси и 12 643 лв. са свързани с валутна сделка.

Към края на периода, друг актив на дружеството е в размер на 48 990 лв., от които 562 лв. са вземания от доставчици по аванси, 20 лв. са свързани с валутна сделка, а 48 407 лв. са вземания от плащания по главница на емисия облигации, притежавана от дружеството.

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 април 2006 г. е изчислена НСА в размер на 21 020 151 лв. Към 31 май НСА е в размер на 21 362 565 лв.

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



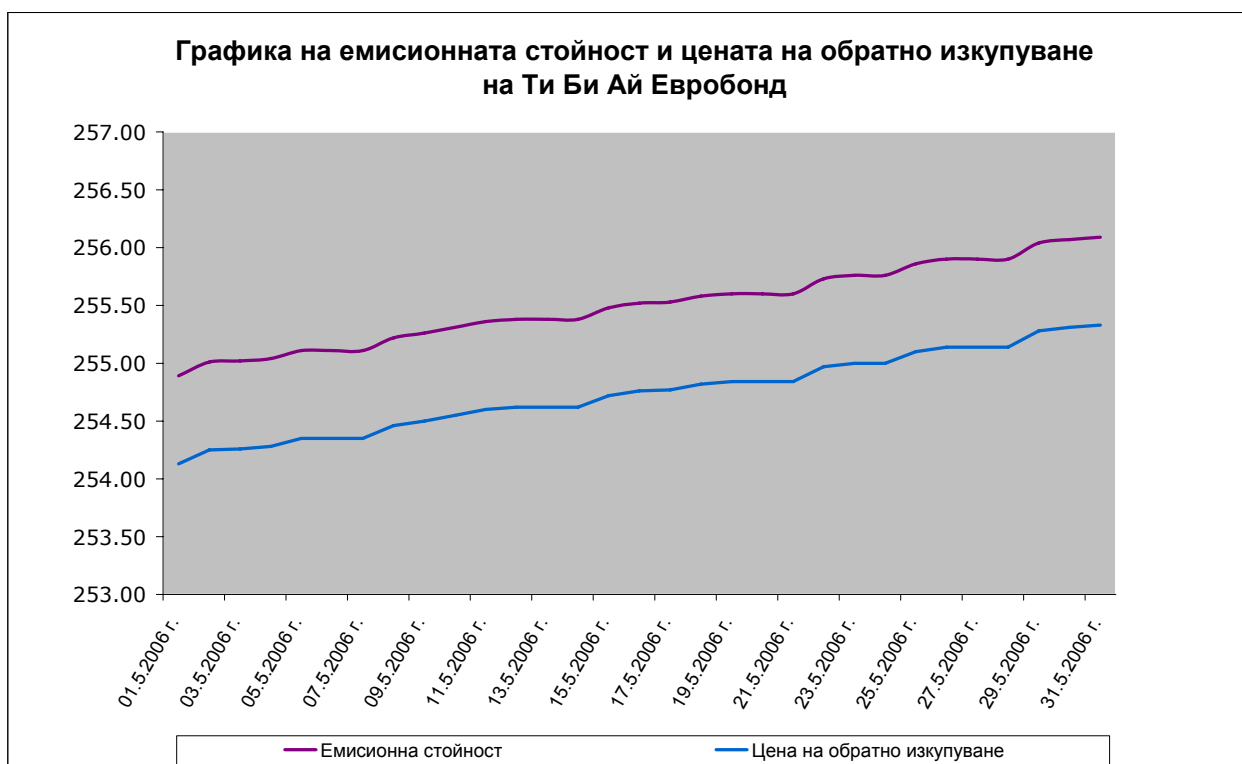
Средната нетна стойност на активите за периода от 01.05.2006 г. до 31.05.2006 г. е 21 127 450 лв., а средногодишната нетна стойност на активите към 31.05.2006 г. е 21 279 755 лв.

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 01/05/2006 – 31/05/2006 е представена в таблицата и графиката по-долу:

Дата:	Емисионна стойност:	Цена обратно изкупуване:
31/05/2006	256.07	255.31
30/05/2006	256.04	255.28
29/05/2006	255.90	255.14
26/05/2006	255.86	255.10
25/05/2006	255.76	255.00
23/05/2006	255.73	254.97
22/05/2006	255.60	254.84
19/05/2006	255.58	254.82
18/05/2006	255.53	254.77
17/05/2006	255.52	254.76

16/05/2006	255.48	254.72
15/05/2006	255.38	254.62
12/05/2006	255.36	254.60
11/05/2006	255.31	254.55
10/05/2006	255.26	254.50
09/05/2006	255.22	254.46
08/05/2006	255.11	254.35
05/05/2006	255.04	254.28
04/05/2006	255.02	254.26
03/05/2006	255.01	254.25
02/05/2006	254.89	254.13



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

През месец май са записани 1 520 акции. Таблицата по-долу представя продажбата на акции на ИД “Ти Би Ай Евробонд” АД за месец май.

Дата	Операция	Брой акции	Емисионна цена	Сума лв.
04/05/2006 г.	записване	156.00	255.02	39 783.12

05/05/2006 г.	записване	11.00	255.04	2 805.44
12/05/2006 г.	записване	6.00	255.36	1 532.16
26/05/2006 г.	записване	1 337.00	255.86	342 084.82
30/05/2006 г.	записване	9.00	256.04	2 304.36
31/05/2006 г.	записване	1.00	256.07	256.07

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

През месец май са изкупени обратно 569 акции. Таблицата по-долу представя обратното изкупуване на акции на ИД “Ти Би Ай Евробонд” АД за месец май.

Дата	Операция	Брой Акции	Цена на обратно изкупуване	Сума лв.
02/05/2006 г.	обратно изкупуване	10.00	254.13	2 541.30
03/05/2006 г.	обратно изкупуване	65.00	254.25	16 526.25
09/05/2006 г.	обратно изкупуване	45.00	254.46	11 450.70
11/05/2006 г.	обратно изкупуване	20.00	254.55	5 091.00
12/05/2006 г.	обратно изкупуване	19.00	254.60	4 837.40
16/05/2006 г.	обратно изкупуване	20.00	254.72	5 094.40
18/05/2006 г.	обратно изкупуване	11.00	254.77	2 802.47
19/05/2006 г.	обратно изкупуване	6.00	254.82	1 528.92
23/05/2006 г.	обратно изкупуване	23.00	254.97	5 864.31
25/05/2006 г.	обратно изкупуване	8.00	255.00	2 040.00
26/05/2006 г.	обратно изкупуване	28.00	255.10	7 142.80
29/05/2006 г.	обратно изкупуване	285.00	255.14	72 714.90
30/05/2006 г.	обратно изкупуване	27.00	255.28	6 892.56
31/05/2006 г.	обратно изкупуване	2.00	255.31	510.62

В резултат на посочените по-горе записвания и обратни изкупувания, към 31.05.2006 г. общият брой на акции на дружеството възлиза на 83 541 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
12/05/2006	покупка	корпоративни облигации	200 000	200 000.00 (EUR)

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*).