

**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 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 и продадени корпоративни облигации деноминирани в евро. Делът на корпоративните облигации е 64.84%, от които 3.66% са чуждестранни ценни книжа. Инвестициите в държавни ценни книжа, емитирани по вътрешния дълг на Република България са 10.34% от активите на инвестиционното дружество. Средствата, инвестирани в общински облигации съставляват 0.24% от всички активи. Паричните средства по депозити и разплащателни сметки са 24.52%. Активите, деноминирани във валута са 85.04%. Доходността, постигната от началото на публичното предлагане (17 ноември 2003 г.) е 8.75%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 31/08/2007 и 30/09/2007 е съответно 19 367 116 лв. и 19 246 397 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.		
	31.07.2007	31.08.2007	30.09.2007
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	338 991	416 651	475 867
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	442 979	517 516	594 010
Заплати, социално и пенсионно осигуряване	10 852	12 400	13 949
Други разходи	3250	3756	4467

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

Разходи за външни услуги	151 601	171 583	190 542
Общо разходи:	947 672	1 121 906	1 278 835

Общият размер на разходите на дружеството към 30/09/2007 г. са 1 278 835 лева, които включват 594 010 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 475 867 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове.

а) Възнаграждение на управляващото дружество

- към 30 септември – 179 986 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.90%

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

- към 30 септември – 1 785 лв.

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

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 30 септември – 1 855 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 30 септември – 14 591 лв.

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

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

- към 30 септември – 630 лв.

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

е) Други разходи на инвестиционното дружество

- към 30 септември – 10 111 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.05%

- Други разходи по финансови операции в размер на 2 683 лв.

- Разходи за възнаграждения – 4 218 лв.

- Разходи за външни услуги (КФН, БФБ, ЦД) – 3 210 лв.

ж) Общ размер на всички разходи по букви а) – е) – 208 958 лв. към месец септември; като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.04%

Долната таблица представя приходите на Дружеството към 31.07.2007, 31.08.2007 и 30.09.2007 г. Приходите са в размер на 2 166 453 лв, включващи преценка от операции с финансови активи и приходи от лихви.

Приходи	Стойност в лв.		
	31.07.2007	31.08.2007	30.09.2007
Приходи от лихви	845 873	955 630	1 059 658
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	478 630	559 534	642 751
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	328 797	405 215	464 044
Общо приходи:	1 653 301	1 920 378	2 166 453

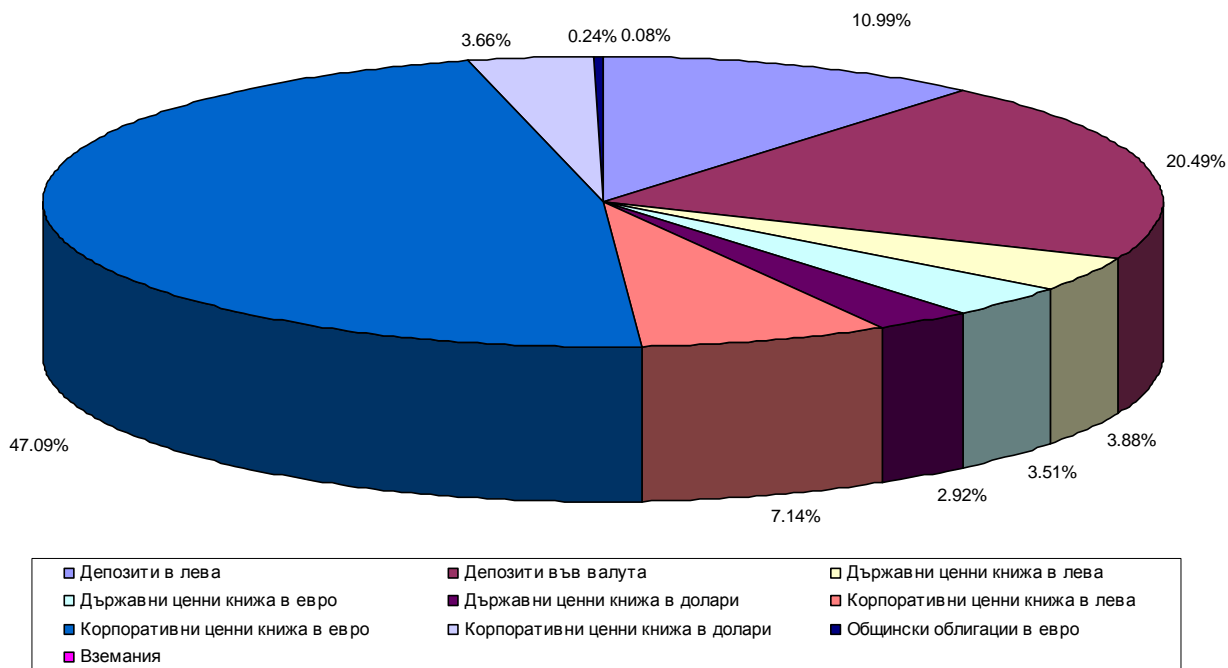
II. Данни по чл. 18, ал. 2 от Наредба № 26

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 31/08/2007		
Актив	Процент от активите	Стойност в лева
Депозити в лева	10.99%	2 128 520.31
Депозити във валута	20.49%	3 967 983.36
Държавни ценни книжа в лева	3.88%	750 856.08
Държавни ценни книжа в евро	3.51%	680 038.07
Държавни ценни книжа в долари	2.92%	565 096.74
Корпоративни ценни книжа в лева	7.14%	1 382 830.94
Корпоративни ценни книжа в евро	47.09%	9 119 466.45
Корпоративни ценни книжа в долари	3.66%	709 489.97
Общински облигации в евро	0.24%	46 408.38
Вземания	0.08%	16 426.19
Total:	100.00%	19 367 116.50

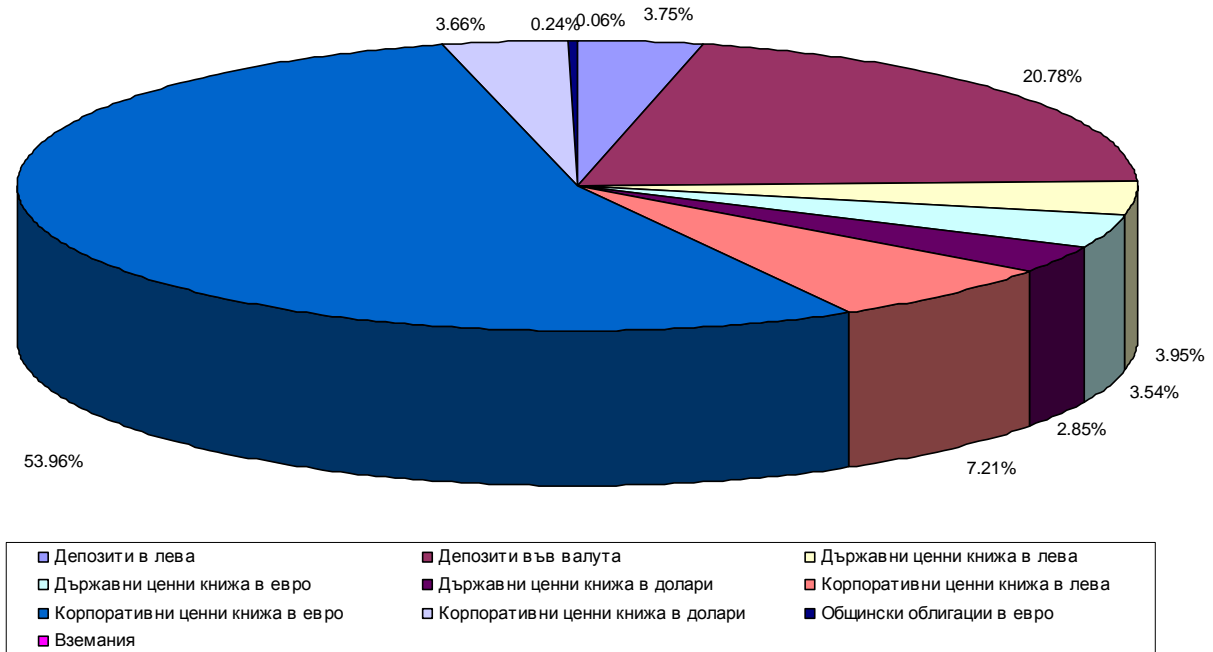
Разпределение на активите на Ти Би Ай Евробонд към 31/08/2007



Таблицата и графиката по-долу представят обема и структурата на активите към 30.09.2007 г.

Структура на портфейла на Ти Би Ай Евробонд АД към 30/09/2007		
Актив	Процент от активите	Стойност в лева
Депозити в лева	3.75%	720 789.00
Депозити във валута	20.78%	3 998 599.87
Държавни ценни книжа в лева	3.95%	759 905.25
Държавни ценни книжа в евро	3.54%	682 138.02
Държавни ценни книжа в долари	2.85%	548 429.74
Корпоративни ценни книжа в лева	7.21%	1 388 128.90
Корпоративни ценни книжа в евро	53.96%	10 385 458.25
Корпоративни ценни книжа в долари	3.66%	705 022.61
Общински облигации в евро	0.24%	46 653.36
Вземания	0.06%	11 272.44
Total:	100.00%	19 246 397.44

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Евробонд към
30/09/2007**



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

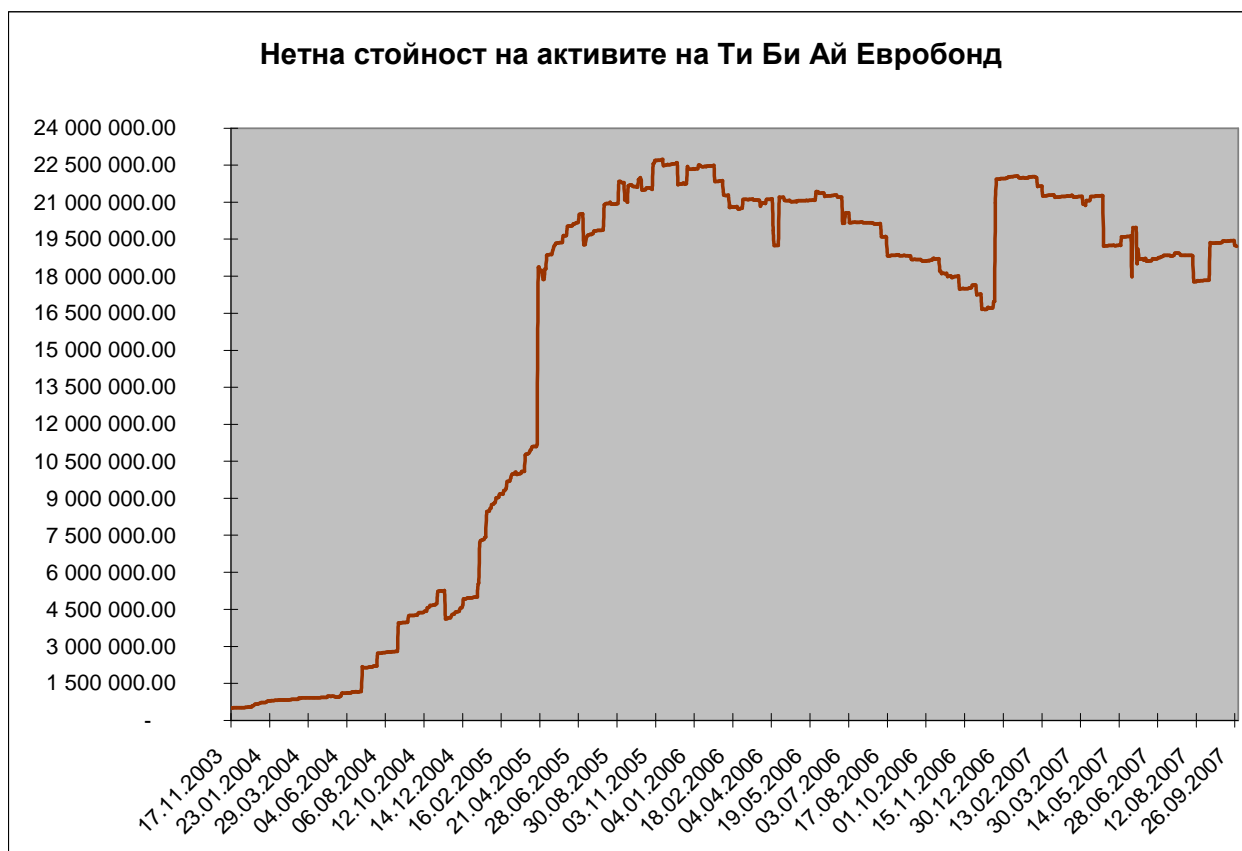
В началото на периода друг актив на дружеството е в размер на 16 426 лв, от които 230 лв. са вземания от доставчици по аванси и 16 196 лв. са от валутна сделка.

Към края на периода друг актив на дружеството е в размер на 11 272 лв, от които 700 лв. са вземания от доставчици по аванси, 9 518 лв. са от валутна сделка, а 1 055 лв. са вземания от лихвено плащане.

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 2007 г. е изчислена НСА в размер на 19 335 643 лв. Към 30 септември НСА е в размер на 19 210 445 лв.

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



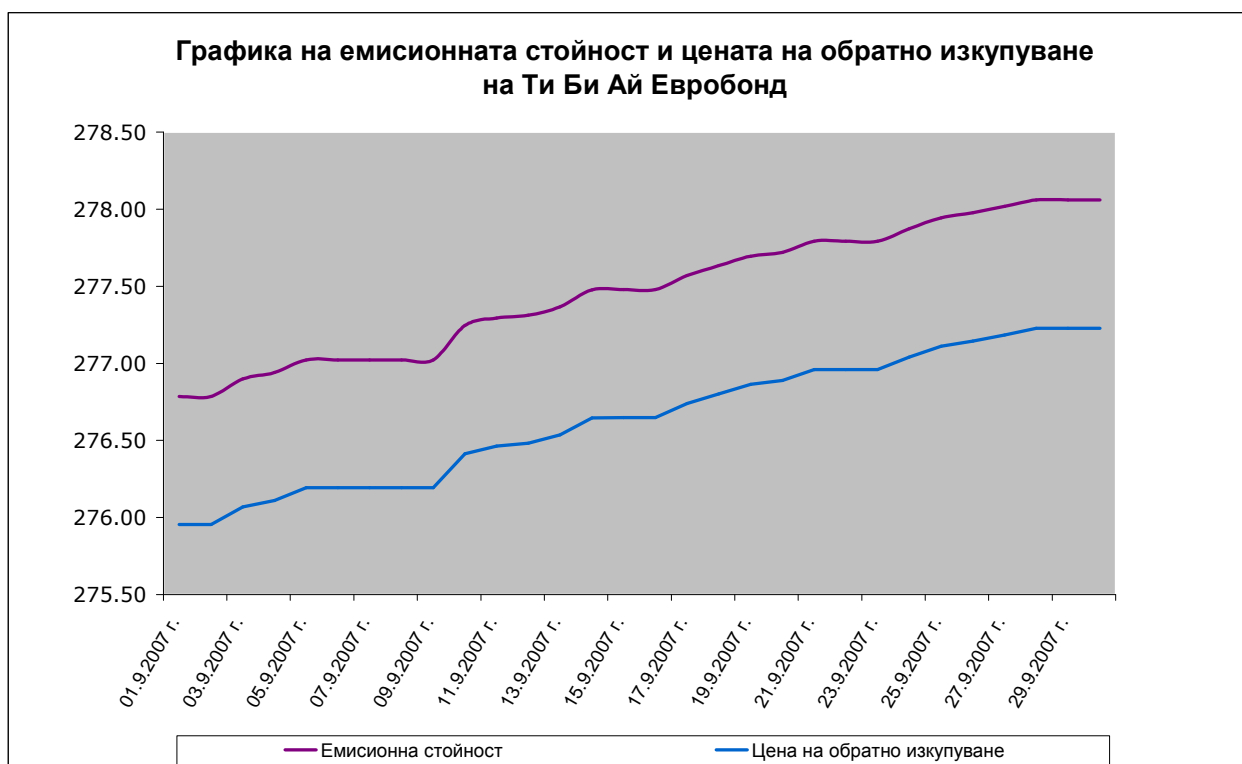
Средната нетна стойност на активите за периода от 01.09.2007 г. до 30.09.2007 г. е 19 366 580 лв., а средногодишната нетна стойност на активите към 30.09.2007 г. е 20 023 200 лв.

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 01/09/2007 – 30/09/2007 е представена в таблицата и графиката по-долу:

Дата:	Емисионна стойност:	Цена обратно изкупуване:
28/09/2007	278.0166	277.1838
27/09/2007	277.9774	277.1448
26/09/2007	277.9438	277.1112
25/09/2007	277.8726	277.0402
24/09/2007	277.7921	276.9599
21/09/2007	277.7202	276.8882
20/09/2007	277.6948	276.8630
19/09/2007	277.6329	276.8013

18/09/2007	277.5688	276.7374
17/09/2007	277.4781	276.6469
15/09/2007	277.4775	276.6463
14/09/2007	277.3664	276.5356
13/09/2007	277.3116	276.4810
12/09/2007	277.2938	276.4632
11/09/2007	277.2445	276.4141
10/09/2007	277.0217	276.1919
05/09/2007	276.9391	276.1095
04/09/2007	276.8974	276.0680
03/09/2007	276.7842	275.9550



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

През месец септември са записани 232 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.
10/09/2007	записване	10	276.94	2 769.39
12/09/2007	записване	216	277.29	59 895.46
21/09/2007	записване	6	277.72	1 666.32

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

През месец септември са изкупени обратно 1 004 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.
05/09/2007	обратно изкупуване	14	276.11	3 865.53
11/09/2007	обратно изкупуване	5	276.41	1 382.07
13/09/2007	обратно изкупуване	34	276.48	9 400.35
15/09/2007	обратно изкупуване	45	276.65	12 449.08
19/09/2007	обратно изкупуване	22	276.80	6 089.63
24/09/2007	обратно изкупуване	4	276.96	1 107.84
25/09/2007	обратно изкупуване	39	277.04	10 804.57
26/09/2007	обратно изкупуване	686	277.11	190 098.28
27/09/2007	обратно изкупуване	15	277.14	4 157.17
28/09/2007	обратно изкупуване	140	277.18	38 805.73

В резултат на посочените по-горе записвания и обратни изкупувания, към 30.09.2007 г. общият брой на акции на дружеството възлиза на 69 191 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
14/09/2007	покупка	корпоративни облигации	700 000	700 000.00
27/09/2007	продажба	корпоративни облигации	43 000	50 215.48
27/09/2007	продажба	корпоративни облигации	24 000	49 275.54
27/09/2007	продажба	корпоративни облигации	24 000	49 055.94

II. 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	99.397	\$397 588.57
XS0301590047	USD	200 000.00	102.860	\$205 720.00
XS0254845844	USD	100 000.00	92.474	\$92 474.00

Обща рискова позиция	\$695 782.57
-----------------------------	---------------------

Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форурдна покупка	EUR/USD	€ 500 000.00	1.40410	\$702 050.00	ОТС	България

Обща хеджираща позиция	\$702 050.00
-------------------------------	---------------------

Стоян Гошев

Изпълнителен директор

Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД