

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

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 4.04% и 32.84%, от които 1.92% в 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 1.66% от всички активи. Паричните средства по депозити и разплащателни сметки са 60.68%. Активите, деноминирани във валута са 74.26%. Доходността, постигната от началото на публичното предлагане (17 ноември 2003 г.) е 9.65%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 31/07/2006 и 31/08/2006 е съответно 20 168 724 лв. и 18 862 590 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.		
	30.06.2006	31.07.2006	31.08.2006
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	613 025	701 565	772 385
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	1 043 192	1 144 959	1 263 257
Заплати, социално и пенсионно осигуряване	8 629	9 976	11 481
Други разходи	1614	1706	2411
Разходи за външни услуги	148 751	170 875	191 779
Общо разходи:	1 815 212	2 029 080	2 241 314

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

Общият размер на разходите на дружеството към 31/08/2006 г. са 2 241 314 лева, които включват 1 263 257 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 772 385 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 август – 180 131 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.86%

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

- към 31 август – 840 лв.

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

в) Възнаграждение на банката депозитар

- към 31 август – 1 653 лв.

- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.008%

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

- към 31 август – 10 763 лв.

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

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: 0.003%

е) Други разходи на инвестиционното дружество

- към 31 август – 11 724

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

- Други разходи по финансови операции в размер на 1 571 лв.

- Разходи за възнаграждения – 4 370 лв.

- Разходи за външни услуги (КФН, БФБ, ЦД, в-к „Пари”, в-к „Дневник”) – 5 783 лв.

ж) Общ размер на всички разходи по букви а) – е) – 205 671 лв. към месец август; като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.98%

Долната таблица представя приходите на Дружеството към 30.06.2006, 31.07.2006 и 31.08.2006 г. Приходите са в размер на 2 978 119 лв, включващи преценка от операции с финансови активи и приходи от лихви.

Приходи	Стойност в лв.		
	30.06.2006	31.07.2006	31.08.2006
Приходи от лихви	748 729	873 101	992 141
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	978 358	1 080 051	1 224 629
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	599 530	689 060	761 349
Общо приходи:	2 326 616	2 642 212	2 978 119

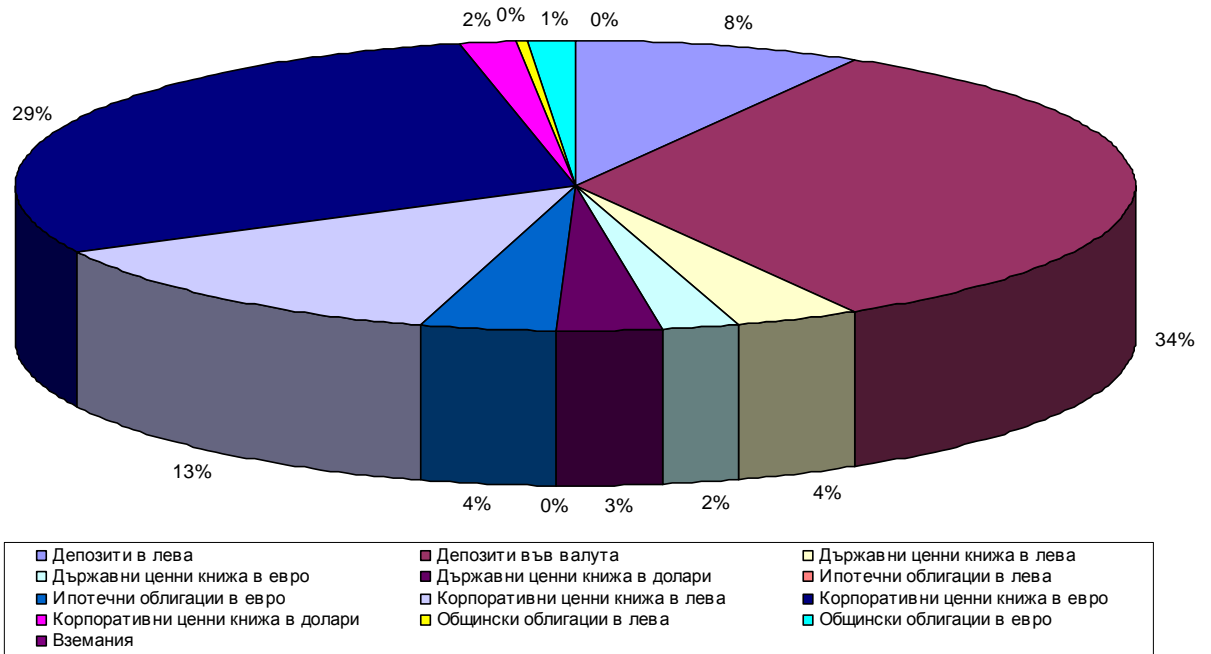
II. Данни по чл. 18, ал. 2

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 31/07/2006		
Актив	Процент от активите	Стойност в лева
Депозити в лева	8.32%	1 660 973.64
Депозити във валута	33.32%	6 719 261.16
Държавни ценни книжа в лева	3.81%	768 302.68
Държавни ценни книжа в евро	2.04%	411 439.98
Държавни ценни книжа в долари	3.28%	660 697.53
Ипотечни облигации в лева	0.00%	0.00
Ипотечни облигации в евро	3.76%	758 209.05
Корпоративни ценни книжа в лева	13.03%	2 628 492.88
Корпоративни ценни книжа в евро	29.14%	5 877 724.31
Корпоративни ценни книжа в долари	1.79%	361 359.10
Общински облигации в лева	0.08%	16 297.70
Общински облигации в евро	1.46%	295 445.84
Вземания	0.05%	10 520.20
Total:	100.08%	20 168 724.07

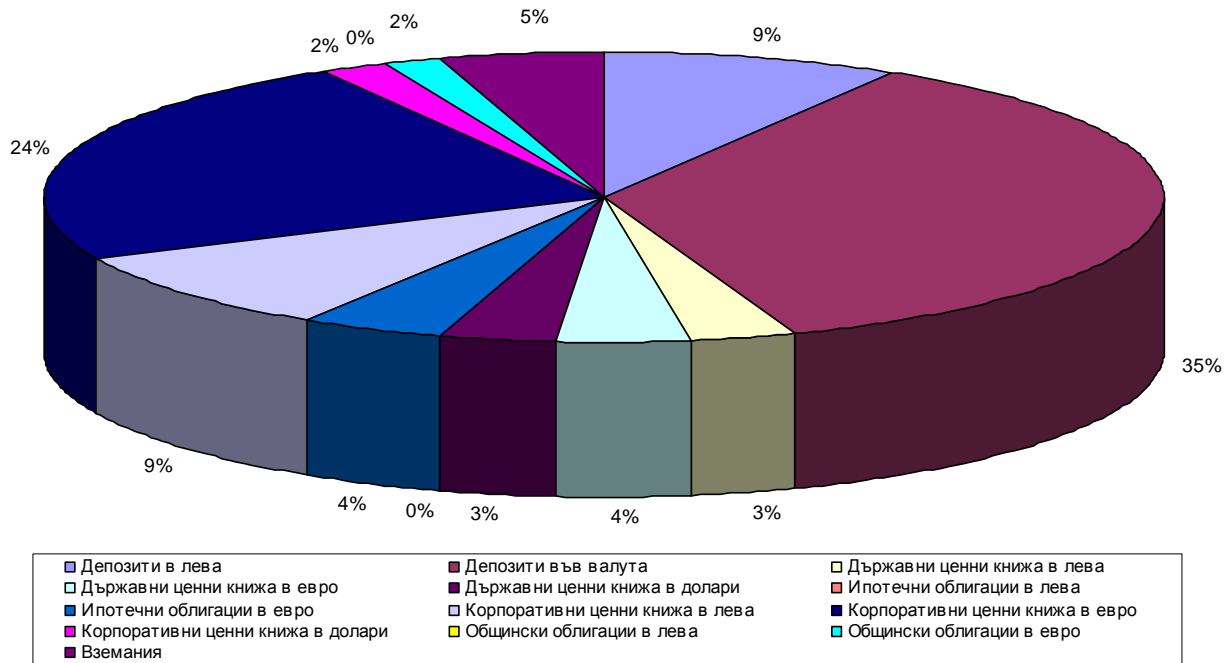
**Разпределение на активите на Ти Би Ай Евробонд към
 31/07/2006**



Таблицата и графиката по-долу представят обема и структурата на активите към 31.08.2006 г.

Структура на портфейла на Ти Би Ай Евробонд АД към 31/08/2006		
Актив	Процент от активите	Стойност в лева
Депозити в лева	8.59%	1 620 373.40
Депозити във валута	35.80%	6 752 610.01
Държавни ценни книжа в лева	2.99%	563 339.68
Държавни ценни книжа в евро	3.90%	735 262.25
Държавни ценни книжа в долари	3.46%	652 598.29
Ипотечни облигации в лева	0.00%	0.00
Ипотечни облигации в евро	4.04%	762 323.99
Корпоративни ценни книжа в лева	9.28%	1 750 309.60
Корпоративни ценни книжа в евро	23.56%	4 444 877.45
Корпоративни ценни книжа в долари	1.92%	362 489.48
Общински облигации в лева	0.09%	16 397.11
Общински облигации в евро	1.57%	297 041.19
Вземания	4.80%	904 967.72
Total:	100.00%	18 862 590.17

**Разпределение на активите на Ти Би Ай Евробонд към
 31/08/2006**



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

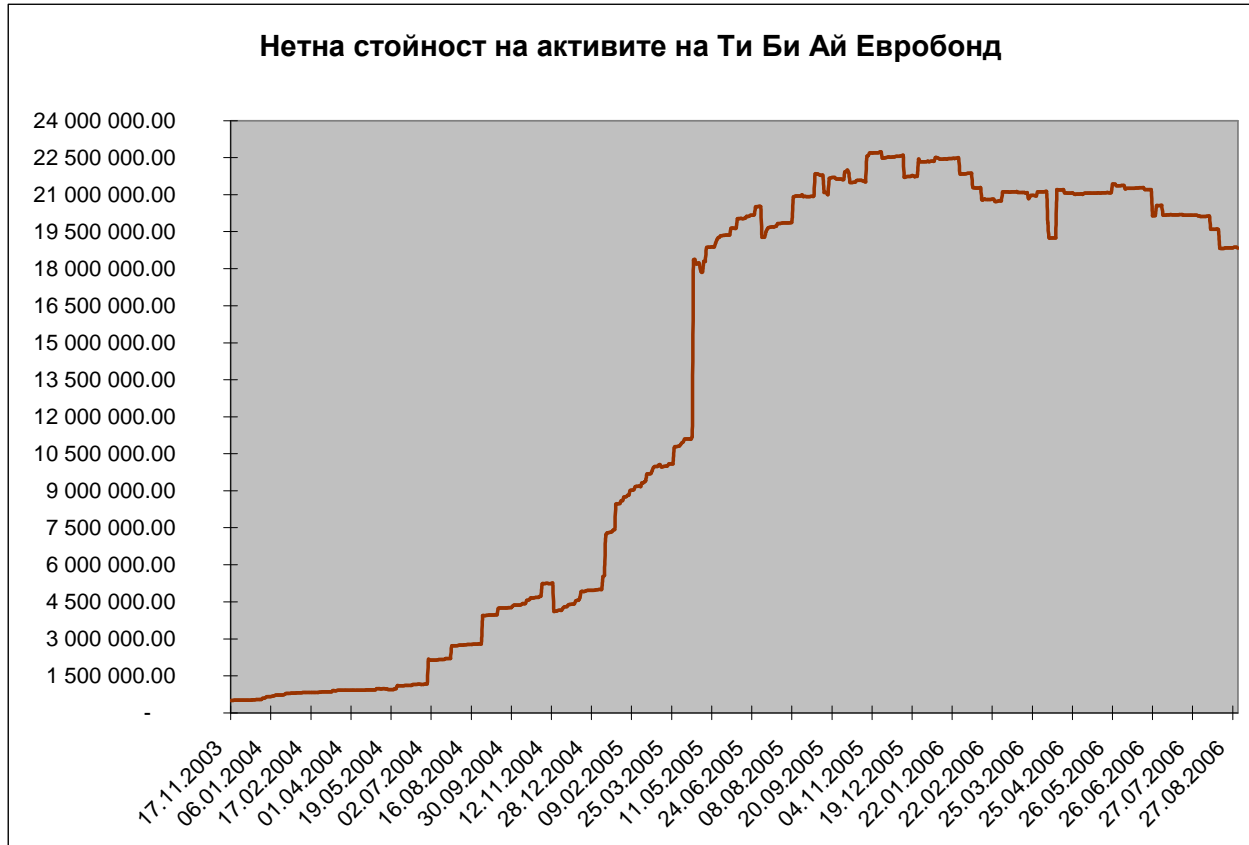
В началото на периода друг актив на дружеството е в размер на 10 520 лв., от които 309 лв. са вземания от доставчици по аванси, а 10 211 лв. са свързани с валутна сделка.

Към края на периода, друг актив на дружеството е в размер на 904 968 лв., от които 229 лв. са вземания от доставчици по аванси, 3 013 лв. са свързани с валутна сделка, а 901 726 лв. са вземане от продажба на корпоративни облигации.

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 2006 г. е изчислена НСА в размер на 20 142 333 лв. Към 31 август НСА е в размер на 18 829 988 лв.

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



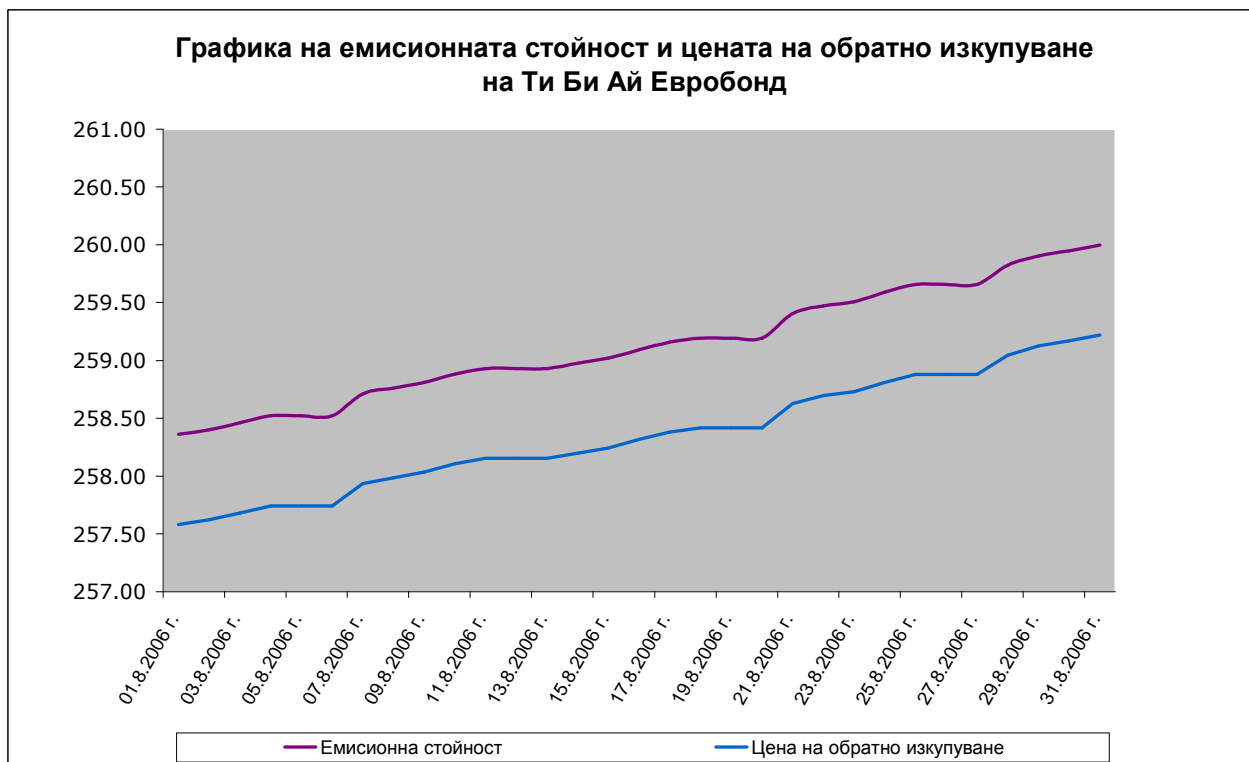
Средната нетна стойност на активите за периода от 01.08.2006 г. до 31.08.2006 г. е 19 384 831 лв., а средногодишната нетна стойност на активите към 31.08.2006 г. е 20 880 686 лв.

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 01/08/2006 – 31/08/2006 е представена в таблицата и графиката по-долу:

Дата:	Емисионна стойност:	Цена обратно изкупуване:
31/08/2006	259.9488	259.1702
30/08/2006	259.9032	259.1246
29/08/2006	259.8236	259.0452
28/08/2006	259.6576	258.8798
25/08/2006	259.5888	258.8112
24/08/2006	259.5069	258.7295
23/08/2006	259.4714	258.6942
22/08/2006	259.4052	258.6282
21/08/2006	259.1925	258.4161

18/08/2006	259.1572	258.3808
17/08/2006	259.0919	258.3157
16/08/2006	259.0196	258.2438
15/08/2006	258.9753	258.1995
14/08/2006	258.9305	258.1549
11/08/2006	258.8820	258.1066
10/08/2006	258.8102	258.0350
09/08/2006	258.7612	257.9860
08/08/2006	258.7110	257.9360
07/08/2006	258.5200	257.7400
04/08/2006	258.4600	257.6800
03/08/2006	258.4000	257.6200
02/08/2006	258.3600	257.5800
01/08/2006	258.3400	257.5600



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

През месец юли са записани 37 акции. Таблицата по-долу представя продажбата на акции на ИД “Ти Би Ай Евробонд” АД за месец август.

Дата	Операция	Брой акции	Емисионна цена	Сума лв.
08/08/2006 г.	записване	10	258.71	2 587.11
25/08/2006 г.	записване	12	259.59	3 115.07
30/08/2006 г.	записване	15	259.90	3 898.55

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

През месец август са изкупени обратно 5 590 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.
01/08/2006	обратно изкупуване	19	257.56	4 893.64
02/08/2006	обратно изкупуване	132	257.58	34 000.56
04/08/2006	обратно изкупуване	16	257.68	4 122.88
08/08/2006	обратно изкупуване	9	257.94	2 321.42
09/08/2006	обратно изкупуване	17	257.99	4 385.76
10/08/2006	обратно изкупуване	2 064.00	258.04	532 584.24
11/08/2006	обратно изкупуване	19	258.11	4 904.03
14/08/2006	обратно изкупуване	5	258.15	1 290.77
16/08/2006	обратно изкупуване	156	258.24	40 286.04
17/08/2006	обратно изкупуване	2 879.00	258.32	743 690.90
18/08/2006	обратно изкупуване	48	258.38	12 402.28
21/08/2006	обратно изкупуване	3	258.42	775.25
22/08/2006	обратно изкупуване	23	258.63	5 948.45
25/08/2006	обратно изкупуване	5	258.81	1 294.06
30/08/2006	обратно изкупуване	53	259.12	13 733.61
31/08/2006	обратно изкупуване	142	259.17	36 802.17

В резултат на посочените по-горе записвания и обратни изкупувания, към 31.08.2006 г. общият брой на акции на дружеството възлиза на 72 532 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
03/08/2006	покупка	държавни облигации	169 574	330 385.00
03/08/2006	продажба	държавни облигации	415 000	419 150.00
10/08/2006	продажба	държавни облигации	261 664.22	500 000.00
12/08/2006	продажба	корпоративни облигации	342 000	354 825.00

14/08/2006	покупка	държавни облигации	415 000	419 544.47
14/08/2006	продажба	корпоративни облигации	50 000	99 178.02
14/08/2006	продажба	държавни облигации	87 184	100 000.00
16/08/2006	продажба	държавни облигации	297 915	300 000.40
16/08/2006	продажба	държавни облигации	363 723.90	700 000.00
16/08/2006	покупка	корпоративни облигации	500 000	500 000.00
17/08/2006	продажба	държавни облигации	198 600	200 000.00
17/08/2006	продажба	държавни облигации	404 700	600 000.00
18/08/2006	продажба	корпоративни облигации	790 000	806 317.44
18/08/2006	продажба	корпоративни облигации	75 000	146 729.16
21/08/2006	покупка	държавни облигации	87 184	100 060.72
21/08/2006	покупка	държавни облигации	198 600	200 075.56
21/08/2006	покупка	държавни облигации	404 700	600 226.67
23/08/2006	покупка	държавни облигации	297 915	300 181.23
23/08/2006	продажба	корпоративни облигации	50 000	99 344.24
25/08/2006	продажба	корпоративни облигации	50 000	99 987.34
29/08/2006	продажба	корпоративни облигации	34 000	34 773.65
29/08/2006	продажба	корпоративни облигации	63 000	87 192.25
29/08/2006	продажба	корпоративни облигации	25 000	50 272.31
29/08/2006	продажба	корпоративни облигации	70 000	140 885.66
30/08/2006	покупка	държавни облигации	363 723.90	700 857.50
30/08/2006	продажба	държавни облигации	175 000	200 550.00
31/08/2006	продажба	корпоративни облигации	620 000	901 726.06

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