

ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО ИЗИСКВАНИЯТА НА ЧЛ. 48 ОТ НАРЕДБА № 25 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА ИД И ДФ

ИД ТИ БИ АЙ ЕВРОБОНД АД

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 и държавни ценни книжа, деноминирани в лева и евро и са закупени ипотечни и корпоративни облигации в евро. Делът на корпоративните облигации е 57.66%, от които 1.81% са чуждестранни ценни книжа. Инвестициите в държавни ценни книжа, емитирани по вътрешния дълг на Република България са 8.00% от активите на инвестиционното дружество. Средствата, инвестирани в общински облигации съставляват 0.26% от всички активи и 7.54% в ипотечни облигации. Паричните средства по депозити и разплащателни сметки са 26.45%. Активите, деноминирани във валута са 93.50%. Доходността, постигната от началото на публичното предлагане (17 ноември 2003 г.) е 8.36%¹.

I. Данни по чл. 48, ал. 3 от Наредба № 25

1) Данни по чл. 48, ал. 3 т. 1: Обем и структура на инвестициите в портфейл по емитенти и видове ценни книжа и други финансови инструменти

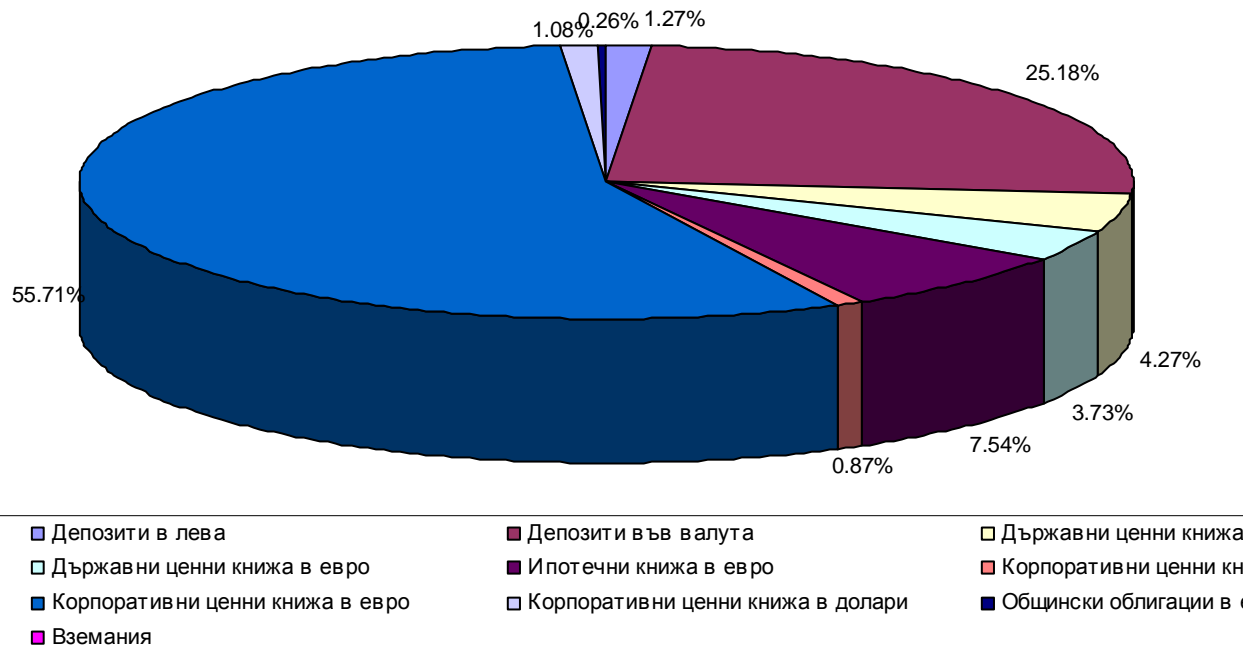
Таблицата и графиката по-долу представят обема и структурата на активите към 30.06.2008г.

Структура на портфейла на Ти Би Ай Евробонд АД към 30/06/2008		
Актив	Стойност на актив	Процент от активите
1. Парични средства в каса в лева	457.03	0.00%
2. Парични средства в разплащателни сметки в лева	148 711.31	1.26%
3. Парични средства в разплащателни сметки във валута	1 533.65	0.01%
4. Депозит в лева	403.21	0.00%
5. Депозит във валута	2 971 016.87	25.17%
6. Дългови ценни книжа		
Държавни ценни книжа		
BG2030004118	347 300.71	2.94%
BG2040202215	130 351.67	1.10%
BG2040103215	25 840.89	0.22%
BG2040099223	440 295.72	3.73%
Общински облигации		
BG2100003057	30 352.34	0.26%

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

Ипотечни облигации		
BG2100011035	98 718.72	0.84%
BG2100009088	791 270.81	6.70%
Корпоративни ценни книжа		
BG2100014054	102 504.16	0.87%
BG2100024061	414 072.09	3.51%
BG2100032056	196 190.89	1.66%
BG2100030068	172 166.52	1.46%
BG2100027056	170 269.86	1.44%
BG2100014062	439 007.50	3.72%
BG2100017065	73 760.64	0.62%
BG2100010078	424 607.20	3.60%
BG2100037063	283 824.33	2.40%
BG2100007074	342 803.44	2.90%
BG2100036057	297 140.90	2.52%
BG2100001077	380 615.52	3.22%
BG2100031066	559 675.53	4.74%
BG2100017040	238 972.48	2.02%
BG2100019061	400 268.47	3.39%
BG2100016075	408 048.43	3.46%
BG2100023071	491 404.15	4.16%
BG2100038079	302 644.03	2.56%
BG2100007082	496 961.99	4.21%
BG2100011084	396 707.54	3.36%
Чуждестранни облигации		
XS0301590047	127 480.90	1.08%
XS0304994337	86 310.78	0.73%
7. Вземания	11 984.10	0.10%
Общо активи:	11 803 674.38	100.00%

Разпределение на активите на Ти Би Ай Евробонд към 30/06/2008



II. 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
XS0301590047	USD	100 000.00	102.750	\$102 750.00

Обща рискова позиция	\$102 750.00
-----------------------------	---------------------

Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърдна покупка	EUR/USD	€ 67 700.00	1.55090	\$104 995.93	OTC	България

Обща хеджираща позиция	\$104 995.93
-------------------------------	---------------------

Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Менеджмънт ЕАД