



Асет Менѝжмънт

ИНФОРМАЦИЯ, СЪГЛАСНО ЧЛ. 48 и ЧЛ. 73Г ОТ НАРЕДБА № 25 ЗА ИЗИСКВАНИЯТА КЪМ ДЕЙНОСТТА НА ИНВЕСТИЦИОННИТЕ ДРУЖЕСТВА И ДОГОВОРНИ ФОНДОВЕ ЗА ИНВЕСТИЦИОННО ДРУЖЕСТВО „ТИ БИ АЙ ЕВРОБОНД“

I. Данни по чл. 73г, ал. 1, т. 6 от Наредба № 25

1) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, 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 и закупени корпоративни, ипотечни и общински облигации, деноминирани в лева и евро, както и държавни и чуждестранни книжа в щатски долари. Делът на корпоративните облигации е 52.00% от портфейла на дружеството. Средствата, инвестирани в ипотечни облигации съставляват 5.17% от всички активи, а в общински облигации – 0.25%. Паричните средства по депозити и разплащателни сметки са 33.17%. Активите, деноминирани във валута са 68.64%. Доходността, постигната от началото на публичното предлагане (17 ноември 2003 г.) е 6.45%¹, доходността за последните 12 месеца е 0.44%, а доходността от началото на годината е 0.44%.

2) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „а“ и „д“: Промени в състоянието на активите в рамките на отчетния период

Долната таблица представя приходите на Дружеството към 31.12.2010 г. Приходите са в размер на 1 426 373 лева, включващи преценка от операции с финансови активи, приходи от лихви, положителни курсови разлики и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лв.		
	30.06.2010	30.09.2010	31.12.2010
Приходи от лихви	191 275	280 269	363 714
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	307 128	499 277	621 744
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	126 060	326 849	440 728
Други приходи от финансови операции	109	187	187
Общо приходи:	624 572	1 106 582	1 426 373

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

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



Асет Мениджмънт

Разходи	Стойност в лв.		
	30.06.2010	30.09.2010	31.12.2010
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	120 224	322 764	436 052
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	302 428	512 939	643 376
Заплати, социално и пенсионно осигуряване	9 955	13 289	16 738
Други разходи	2 802	3 549	169 090
Разходи за външни услуги	46 791	70 432	92 570
Общо разходи:	482 200	922 973	1 357 826

Общият размер на разходите на дружеството към 31/12/2010 г. са 1 357 826 лева, които включват 643 376 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 436 052 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество
- към 31 декември – 76 329 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.20%

- б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество
- към 31 декември – 377 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.01%

- в) Възнаграждение на банката депозитар
- към 31 декември – 2 498 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.04%

- г) Възнаграждение на членовете на управителните и на контролните органи на дружеството
- към 31 декември – 20 584 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.32%

- д) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие
- към 31 декември – 960 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.02%

- е) Други разходи на инвестиционното дружество
- към 31 декември – 13 342 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.21%

- Други разходи по финансови операции в размер на 4 410 лв.
- Разходи за възнаграждения – 4 789 лв.
- Разходи за външни услуги (КФН, БФБ, ЦД) – 4 143 лв.



Асет Мениджмънт

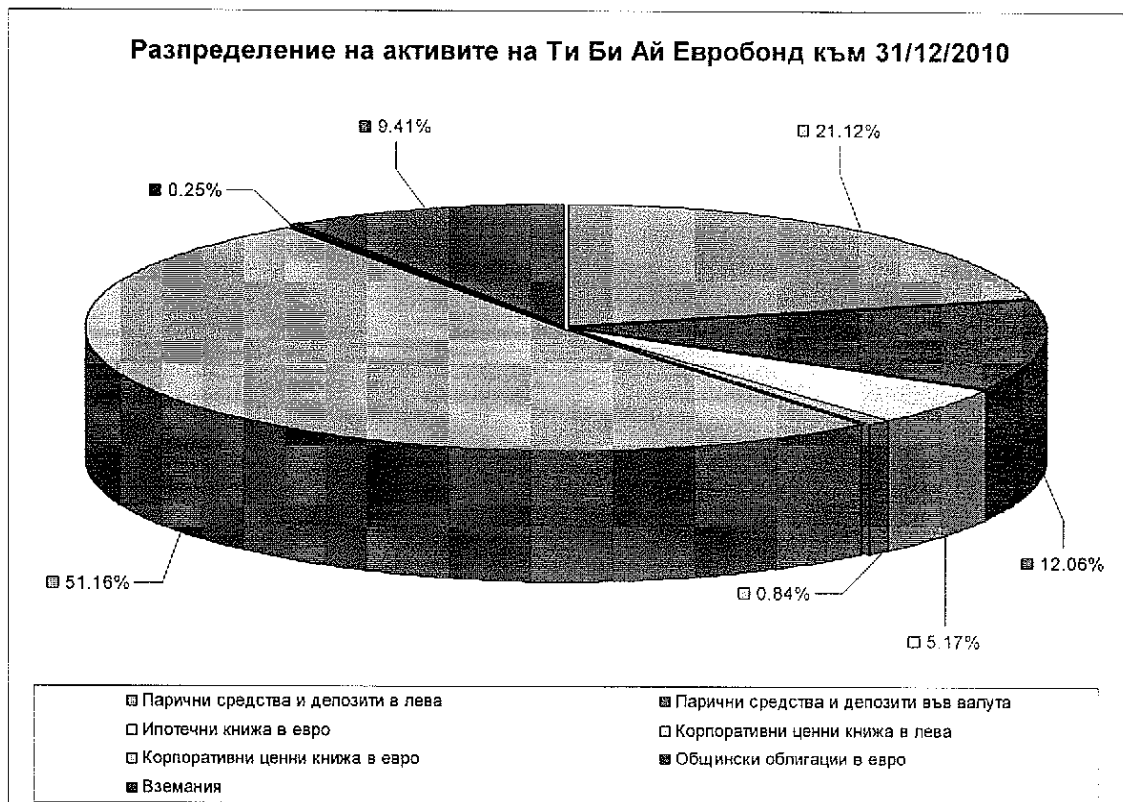
ж) Общ размер на всички разходи по букви а) – е) – 114 089 лв. към месец декември; като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.79%.

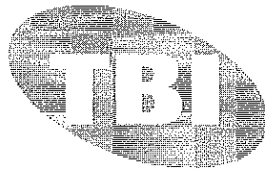
За периода не са записани нови акции и са изкупени обратно 3 284 броя акции. НСА на Дружеството към 30.09.2010 г. е 6 295 117 лв., а към 31.12.2010 г. - 5 117 810 лв. Броят акции към края на отчетния период е 16 327.

3) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, 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.

Структура на портфейла на Ти Би Ай Евробонд АД към 31/12/2010		
Актив	Процент от активите	Стойност в лева
Парични средства и депозити в лева	21.12%	1 083 560
Парични средства и депозити във валута	12.06%	618 603
Ипотечни книжа в евро	5.17%	265 217
Корпоративни ценни книжа в лева	0.84%	42 884
Корпоративни ценни книжа в евро	51.16%	2 625 169
Общински облигации в евро	0.25%	12 862
Вземания	9.41%	482 751
Total:	100.00%	5 131 046





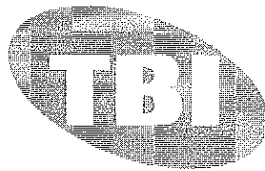
Асет Мениджмънт

4) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „б“: Нетна стойност на активите на една акция

На 30.09.2010 г. е изчислена нетна стойност на активите на една акция в размер на 320.9993 лв. Към 31.12.2010 г. нетната стойност на активите на една акция е 313.4568 лв.

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

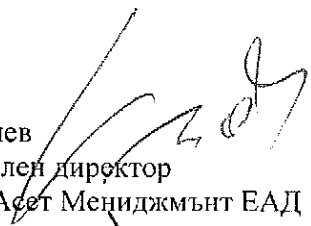





Асет Мениджмънт

II. Данни по чл. 48, ал. 3, т. 2 от от Наредба № 25

Във връзка с притежаваните от Дружеството валутно деноминирани активи, управляващото дружество извършва хеджиращи сделки с цел предпазване от валутния риск, на който е изложено Дружеството. Към 31.12.2010 г. Дружеството не притежава активи, деноминирани във валута, различна от лева и евро и поради тази причина няма сключени хеджиращи сделки.


Стоян Тошев
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД


Мирослав Маринов
Изпълнителен директор
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

