



Асет Мениджмънт

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 и ипотечни облигации, деноминирани в лева и евро. Делът на корпоративните облигации е 45.72% от портфейла на дружеството. Средствата, инвестирани в ипотечни облигации съставляват 9.55% от всички активи, а в общински облигации – 0.67%. Паричните средства по депозити и разплащателни сметки са 16.62%. Активите, деноминирани във валута са 69.84%. Доходността, постигната от началото на публичното предлагане (17 ноември 2003 г.) е 6.20%¹, доходността за последните 12 месеца е -0.44%, а доходността от началото на годината е 1.30%.

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 30.06.2011 г. Приходите са в размер на 95 670 лева, включващи преценка от операции с финансови активи, приходи от лихви, положителни курсови разлики и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лв.		
	31.12.2010	31.03.2011	30.06.2011
Приходи от лихви	363 714	51 864	74,348
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	621 744	17 557	21,220
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	440 728	32	61
Други приходи от финансови операции	187	20	42
Общо приходи:	1 426 373	69 472	95,670

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.		
	31.12.2010	31.03.2011	30.06.2011
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	435 930	257	321
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	807 685	13 578	19 998
Заплати, социално и пенсионно осигуряване	16 738	3 328	6 650
Други разходи	4 903	1 107	1 625
Разходи за външни услуги	92 570	14 773	24 144
Общо разходи:	1 357 826	33 043	52 738

Общият размер на разходите на дружеството към 30/06/2011 г. е 52 738 лева, които включват 19 998 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 321 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество
- към 30 юни – 16 003 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.60%
- б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество
- към 30 юни – 484 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.02%
- в) Възнаграждение на банката депозитар
- към 30 юни – 1 280 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.05%
- г) Възнаграждение на членовете на управителните и на контролните органи на дружеството
- към 30 юни – 8 244 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.31%
- д) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие
- към 30 юни – 480 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.02%
- е) Други разходи на инвестиционното дружество
- към 30 юни – 5 928 лв.
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.22%
- Други разходи по финансови операции в размер на 1 141 лв.
- Разходи за възнаграждения – 2 726 лв.
- Разходи за външни услуги (КФН, БФБ, ЦД) – 2 061 лв.



ж) Общ размер на всички разходи по букви а) – е) – 32 419 лв. към месец юни; като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 1.21%.

За периода не са записани нови акции и са изкупени обратно 1 147 броя акции. НСА на Дружеството към 31.12.2010 г. е 5 117 810 лв., към 31.03.2010 г. - 1 973 530 лв., а към 30.06.2011 г. - 1 616 860 лв. Броят акции към края на отчетния период е 5 092.

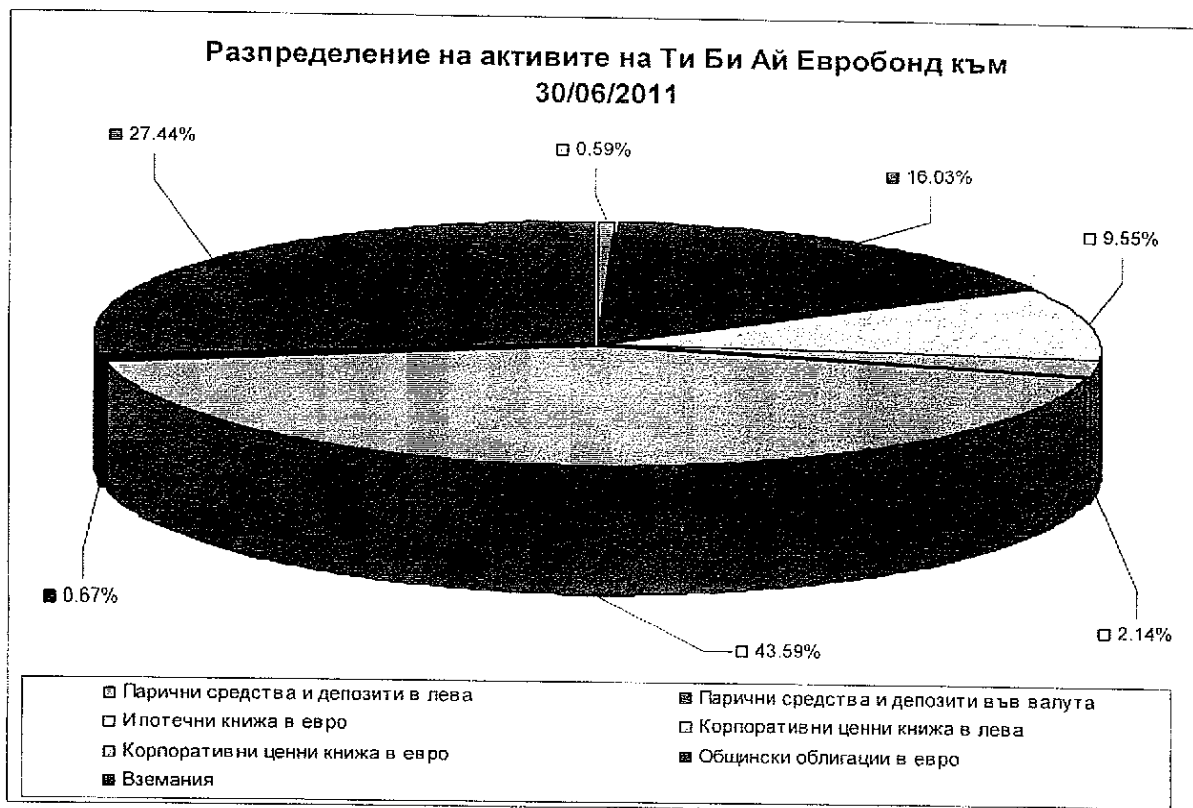
3) Данни по чл. 73г, ал. 1 т. 6, б. „в“: Обем и структура на инвестициите в портфейла по видове финансови инструменти

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 30/06/2011		
Актив	Процент от активите	Стойност в лева
Парични средства и депозити в лева	0.59%	9,589
Парични средства и депозити във валута	16.03%	260,849
Ипотечни книжа в евро	9.55%	155,425
Корпоративни ценни книжа в лева	2.14%	34,766
Корпоративни ценни книжа в евро	43.59%	709,383
Общински облигации в евро	0.67%	10,930
Вземания	27.44%	446,572
Total:	100.00%	1,627,514



Асет Мениджмънт



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

На 31.12.2010 г. е изчислена нетна стойност на активите на една акция в размер на 313.4568 лв. Към 31.03.2011 г. нетната стойност на активите на една акция е 316.3215 лв., а към 30.06.2011 г. нетната стойност на активите на една акция е 317.5294 лв.

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



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 30.06.2011 г. Дружеството няма такива сделки.

Мирослав Маринов

Изпълнителен директор

Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД