

# 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 евро. Делът на корпоративните облигации е 27.05% от портфейла на дружеството. Средствата, инвестирани в ипотечни облигации съставляват 3.61% от всички активи. Паричните средства по депозити и разплащателни сметки са 11.83%. Активите, деноминирани във валута са 42.11%. Доходността, постигната от началото на публичното предлагане (17 ноември 2003 г.) е 5.87%<sup>1</sup>, доходността за последните 12 месеца е - 2.02%, а доходността от началото на годината е 0.34%.

#### 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 30.09.2011 г. Приходите са в размер на 113 010 лева, включващи преоценка от операции с финансови активи, приходи от лихви, положителни курсови разлики и други финансови приходи.

Приходи	Стойност в лв.		
	31.03.2011	30.06.2011	30.09.2011
Приходи от лихви	51 864	74,348	86,764
Приходи от операции с финансови активи и инструменти	17 557	21,220	26,111
Положителни разлики от промяна на валутни курсове	32	61	82
Други приходи от финансови операции	20	42	53
<b>Общо приходи:</b>	<b>69 472</b>	<b>95,670</b>	<b>113,010</b>

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

<sup>1</sup> Доходността е изчислена през нетната стойност на активите на 1 акция за съответните дати.



# Асет Мениджмънт

Разходи	Стойност в лв.		
	31.03.2011	30.06.2011	30.09.2011
Отрицателни разлики от промяна на валутни курсове	257	321	417
Разходи от операции с финансови активи и инструменти	13 578	19,998	37,460
Заплати, социално и пенсионно осигуряване	3 328	6,650	10,861
Други разходи	1 107	1,625	2,315
Разходи за външни услуги	14 773	24,144	30,649
<b>Общо разходи:</b>	<b>33 043</b>	<b>52,738</b>	<b>81,702</b>

Общият размер на разходите на дружеството към 30/09/2011 г. е 81 702 лева, които включват 37 460 лева разходи от операции с финансови активи и инструменти и 417 лева отрицателни разлики от промяна на валутни курсове.

- а) Възнаграждение на управляващото дружество  
- към 30 септември – 18 985 лв.  
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.89%

- б) Платените комисионни на инвестиционния посредник, който изпълнява инвестиционните решения и нареждания, дадени от управляващото дружество  
- към 30 септември – 643 лв.  
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.03%

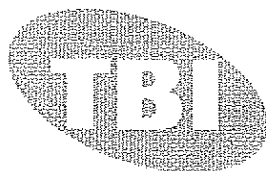
- в) Възнаграждение на банката депозитар  
- към 30 септември – 1 971 лв.  
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.09%

- г) Възнаграждение на членовете на управителните и на контролните органи на дружеството  
- към 30 септември – 12 132 лв.  
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.57%

- д) Възнаграждение на дипломирания експерт-счетоводител, съответно на специализираното одиторско предприятие  
- към 30 септември – 900 лв.  
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.04%

- е) Други разходи на инвестиционното дружество  
- към 30 септември – 9 194 лв.  
- като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 0.43%

- Други разходи по финансови операции в размер на 1 672 лв.  
- Разходи за възнаграждения – 4 187 лв.  
- Разходи за външни услуги (КФН, БФБ, ЦД) – 3 335 лв.



# Асет Мениджмънт

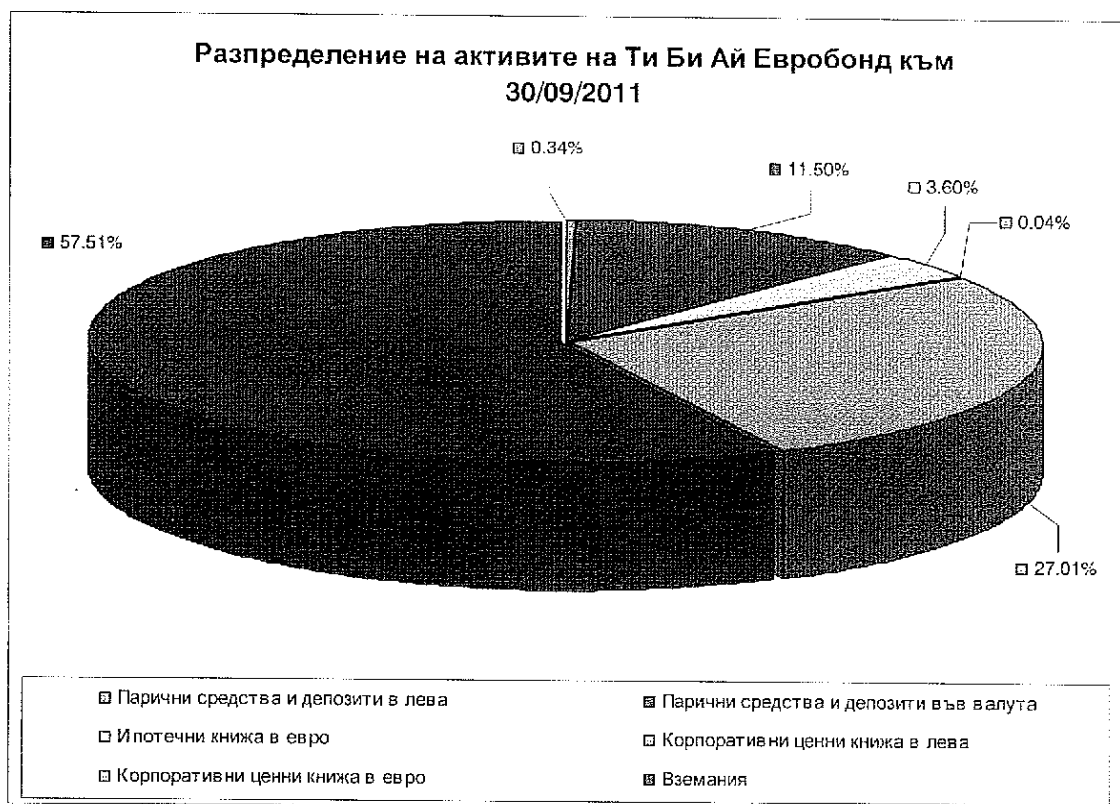
ж) Общ размер на всички разходи по букви а) – е) – 43 825 лв. към месец септември, като процент от средната годишна нетна стойност на активите: 2.05%.

За периода не са записани нови акции и са изкупени обратно 2 650 броя акции. НСА на Дружеството към 31.03.2010 г. е 1 973 530 лв., към 30.06.2011 г. - 1 616 860., а към 30.09.2011 г. - 768 060 лв. Броят акции към края на отчетния период е 2 442.

### 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.

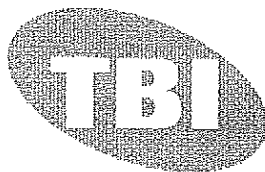
Структура на портфейла на Ти Би Ай Евробонд АД към 30/09/2011		
Актив	Процент от активите	Стойност в лева
Парични средства и депозити в лева	0.33%	2,631
Парични средства и депозити във валута	11.50%	89,412
Ипотечни книжа в евро	3.61%	28,034
Корпоративни ценни книжа в лева	0.04%	309
Корпоративни ценни книжа в евро	27.01%	210,017
Вземания	57.51%	447,260
<b>Total:</b>	<b>100.00%</b>	<b>777,663</b>



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

На 31.03.2011 г. е изчислена нетна стойност на активите на една акция в размер на 316.3215 лв. Към 30.06.2011 г. нетната стойност на активите на една акция е 317.5294 лв., а към 30.09.2011 г. нетната стойност на активите на една акция е 314.5210 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 30.09.2011 г. Дружеството няма такива сделки.

Мирослав Маринов  
Изпълнителен директор  
Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД

