



# Асет Менѝджмънт

## 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 и закупени държавни, корпоративни и ипотечни облигации, деноминирани в евро, и са продадени чуждестранни книжа в долари. Делът на корпоративните облигации е 52.77%, а на държавните ценни книжа е 7.43% от портфейла на дружеството. Средствата, инвестирани в ипотечни облигации съставляват 8.91% от всички активи, а чуждестранните инвестиции – 1.90%. Паричните средства по депозити и разплащателни сметки са 19.33%. Активите, деноминирани във валута са 87.39%. Доходността, постигната от началото на публичното предлагане (17 ноември 2003 г.) е 7.03%<sup>1</sup>, доходността за последните 12 месеца е 4.10%, а доходността от началото на годината е 3.18%.

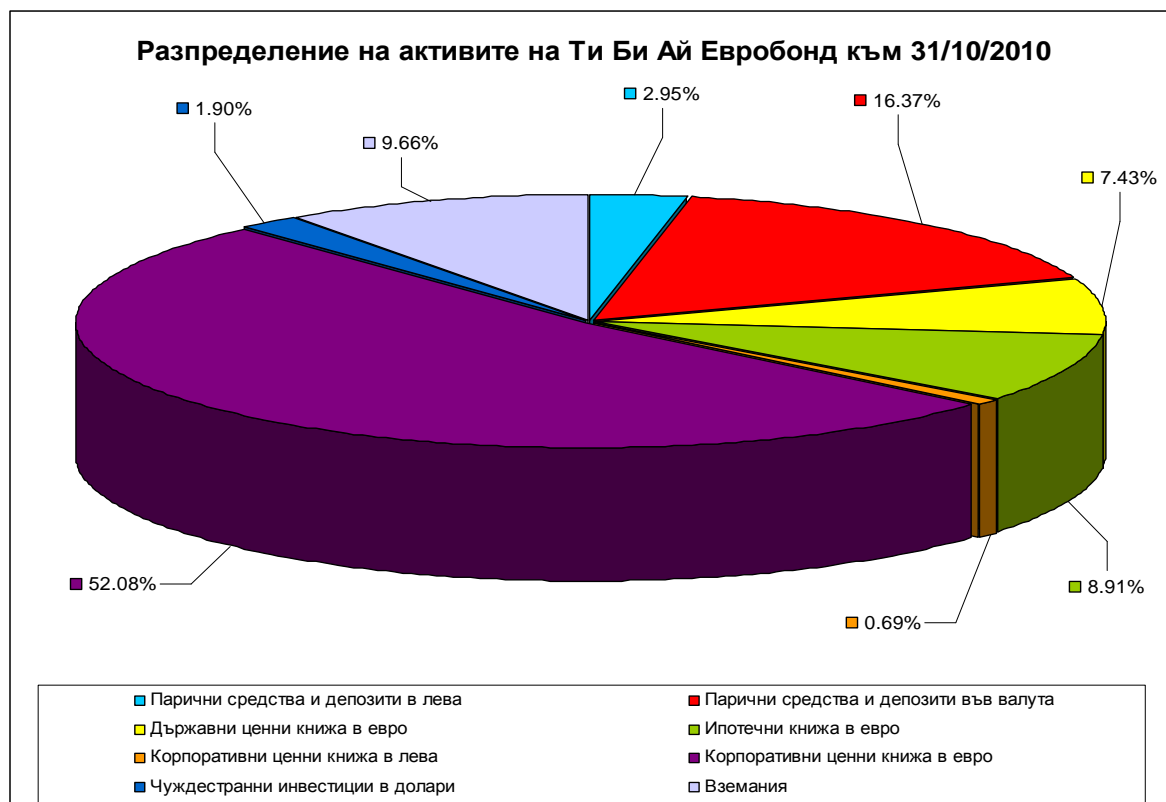
### I. Данни по чл. 48, ал. 3 от Наредба № 25

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 31.10.2010г.

Структура на портфейла на Ти Би Ай Евробонд АД към 31/10/2010		
Актив	Процент от активите	Стойност в лева
Парични средства и депозити в лева	2.95%	186 808
Парични средства и депозити във валута	16.37%	1 036 124
Държавни ценни книжа в евро	7.43%	470 082
Ипотечни книжа в евро	8.91%	563 963
Корпоративни ценни книжа в лева	0.69%	43 866
Корпоративни ценни книжа в евро	52.08%	3 295 306
Чуждестранни инвестиции в долари	1.90%	119 988
Вземания	9.66%	611 347
<b>Total:</b>	<b>100.00%</b>	<b>6 327 484</b>

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



## II. Данни по чл. 48, ал. 3, т. 2 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. Хеджираните активи и сключените сделки са описани по-долу.

### Рисков актив

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност
Валутно деноминиран актив	USD	\$2 150.00	39.540	\$85 011.00
Валутно деноминиран актив	USD	\$219 918.00	1.000	\$219 918.00

<b>Обща рискова позиция</b>	<b>\$304 929.00</b>
-----------------------------	---------------------

### Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 212 000.00	1.39671	\$296 102.52	OTC	България

<b>Обща хеджираща позиция</b>	<b>\$296 102.52</b>
-------------------------------	---------------------

Стоян Тошев  
 Изпълнителен директор  
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД