



Асет Мениджмънт

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 корпоративни и ипотечни облигации, деноминирани в евро, и са продадени държавни книжа в долари. Делът на корпоративните облигации е 52.74% от портфейла на дружеството. Средствата, инвестирани в ипотечни облигации съставляват 8.79% от всички активи, а чуждестранните инвестиции – 6.66%. Паричните средства по депозити и разплащателни сметки са 21.33%. Активите, деноминирани във валута са 79.49%. Доходността, постигната от началото на публичното предлагане (17 ноември 2003 г.) е 7.06%¹, доходността за последните 12 месеца е 4.15%, а доходността от началото на годината е 2.86%.

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 30.09.2010г.

Структура на портфейла на Ти Би Ай Евробонд АД към 30/09/2010		
Актив	Процент от активите	Стойност в лева
Парични средства и депозити в лева	10.03%	632 897
Парични средства и депозити във валута	11.30%	712 880
Ипотечни книжа в евро	8.79%	554 613
Корпоративни ценни книжа в евро	52.74%	3 327 477
Чуждестранни инвестиции в долари	6.66%	420 428
Вземания	10.48%	661 438
Total:	100.00%	6 309 734

¹ 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	\$4 300.00	39.230	\$168 689.00
Валутно деноминиран актив	USD	\$3 985.00	31.290	\$124 690.65

Обща рискова позиция	\$293 379.65
-----------------------------	---------------------

Дериватен инструмент

Вид	Валута	Брой	Цена	Обща Стойност	Пазар	Държава
Форуърд купува EUR/USD	EUR/USD	€ 387 000.00	1.26801	\$490 719.87	ОТС	България
Форуърд продава EUR/USD	EUR/USD	€ 145 000.00	1.31367	\$190 482.15	ОТС	България

Обща хеджираща позиция	\$300 237.72
-------------------------------	---------------------

Стоян Тошев
 Изпълнителен директор
 Ти Би Ай Асет Мениджмънт ЕАД