

ОБЕМ И СТРУКТУРА НА ИНВЕСТИЦИИТЕ В ДЪЛГОВИ ЦЕННИ КНИЖА

на Ай Ен Джи Доброволен пенсионен фонд

/наименование на фонда за допълнително пенсионно осигуряване/

| № по ред | НАИМЕНОВАНИЕ НА ЕМИТЕНТА | Вид икономическа дейност на емитента* | Код на валута | към 31.12.2010 г. | |
|----------|--|---------------------------------------|---------------|---|--|
| | | | | Стойност на дълговите ценни книжа /в хил. лева/ | Относителен дял от активите на фонда /в %/ |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| 1. | Ценни книжа, издадени или гарантирани от българската държава, задълженията по които съставляват държавен или държавногарантиран дълг - общо, в т.ч. по емисии: | | | 3 918 | 6.23% |
| 1.1. | Министерство на Финансите | X | BGN | 656 | 1.04% |
| 1.2. | Министерство на Финансите | X | BGN | 1 172 | 1.86% |
| 1.3. | Министерство на Финансите | X | EUR | 2 090 | 3.32% |
| 2 | Общински ценни книжа, издадени от български общини съгласно Закона за общинския дълг - общо, в т.ч.: | | | - | 0.00% |
| 3 | Ипотечни облигации, издадени съгласно Закона за ипотечните облигации, приети за търговия на регулиран пазар на ценни книжа - общо, в т.ч.: | | | 407 | 0.65% |
| 3.1. | ТБ Българо-Американска Кредитна Банка АД-София | Финансово посредничество | EUR | 407 | 0.65% |
| 4 | Корпоративни облигации, издадени или гарантирани от банки с над 50% държавно участие с цел финансиране на инфраструктурни проекти - общо, в т.ч.: | | | - | 0.00% |
| 5 | Корпоративни облигации, извън посочените в т.3 и 4, приети за търговия на регулиран пазар на ценни книжа - общо, в т.ч.: | | | 349 | 0.56% |
| 5.1. | Балканстрой АД-Разлог | Строителство | EUR | 349 | 0.56% |
| 6 | Обезпечени корпоративни облигации, които не са приети за търговия на регулиран пазар - общо, в т.ч.: | | | - | 0.00% |
| 7 | Дългови ценни книжа, издадени или гарантирани от държави – членки на Европейския съюз, или от други държави – страни по Споразумението за Европейско икономическо пространство, или техни централни банки - общо, в т.ч.: | | | 6 624 | 10.53% |
| 7.1. | Federal Republic of Germany | X | EUR | 4 005 | 6.37% |
| 7.2. | Federal Republic of Germany | X | EUR | 1 256 | 2.00% |
| 7.3. | Federal Republic of Germany | X | EUR | 538 | 0.85% |
| 7.4. | Kreditanstalt für Wiederaufbau | Финансово посредничество | BGN | 826 | 1.31% |
| 8 | Дългови ценни книжа, издадени или гарантирани от държави, посочени в наредба на КФН, или от техни централни банки - общо, в т.ч.: | | | 2 231 | 3.55% |
| 8.1. | United States of America | X | USD | 1 934 | 3.07% |
| 8.2. | United States of America | X | USD | 297 | 0.47% |
| 9 | Дългови ценни книжа, издадени или гарантирани от Европейската централна банка или от Европейската инвестиционна банка - общо, в т.ч.: | | | 2 041 | 3.24% |
| 9.1. | European Investment Bank | Финансово посредничество | BGN | 2 041 | 3.24% |
| 10 | Дългови ценни книжа, издадени от чуждестранни общини, приети за търговия на регулирани пазари на ценни книжа в държави – членки на Европейския съюз, или други държави – страни по Споразумението за Европейско икономическо пространство - общо, в т.ч.: | | | 1 240 | 1.97% |

| № по ред | НАИМЕНОВАНИЕ НА ЕМИТЕНТА | Вид икономическа дейност на емитента* | Код на валута | към 31.12.2010 г. | |
|----------|---|---|---------------|---|--|
| | | | | Стойност на дълговите ценни книжа /в хил. лева/ | Относителен дял от активите на фонда /в %/ |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| 10.1. | Land Nordrhein-Westfalen | X | EUR | 1 240 | 1.97% |
| 11 | Дългови ценни книжа, извън посочените в т. 7, 8, 9 и 10, приети за търговия на регулирани пазари на ценни книжа в държави – членки на Европейския съюз, или други държави – страни по Споразумението за Европейско икономическо пространство - общо, в т.ч.: | | | 15 675 | 24.92% |
| 11.1. | Akzo Nobel NV | Производство на химични продукти | EUR | 238 | 0.38% |
| 11.2. | Avis Finance | Финансово посредничество | EUR | 331 | 0.53% |
| 11.3. | BMW Finance NV | Производство на автомобили, ремаркета и полуремаркета | EUR | 146 | 0.23% |
| 11.4. | Daimler Finance North America LLC | Производство на автомобили, ремаркета и полуремаркета | EUR | 233 | 0.37% |
| 11.5. | E.ON International Finance BV | Производство и разпределение на електрическа и топлинна енергия и на газообразни горива | EUR | 144 | 0.23% |
| 11.6. | EFG Hellas Plc | Друго парично посредничество | BGN | 1 048 | 1.67% |
| 11.7. | EFG Hellas Plc | Друго парично посредничество | BGN | 402 | 0.64% |
| 11.8. | Fortune Brands | Търговско посредничество | EUR | 298 | 0.47% |
| 11.9. | Gaz Capital SA | Производство и разпределение на електрическа и топлинна енергия и на газообразни горива | EUR | 227 | 0.36% |
| 11.10. | GE Capital European Funding | Производство и разпределение на електрическа и топлинна енергия и на газообразни горива | EUR | 253 | 0.40% |
| 11.11. | Grohe Holding | Строителство | EUR | 333 | 0.53% |
| 11.12. | Henkel AG & Co KGaA | Производство на химични продукти | EUR | 152 | 0.24% |
| 11.13. | Holcim Finance Luxembourg SA | Производство на цимент, вар и гипс | EUR | 245 | 0.39% |
| 11.14. | HSBC Bank plc | Финансово посредничество | EUR | 2 651 | 4.21% |
| 11.15. | Impress Holding | Преработваща промишленост | EUR | 345 | 0.55% |
| 11.16. | International Bank for Reconstruction and Development | Финансово посредничество | EUR | 1 321 | 2.10% |
| 11.17. | J.P. Morgan SP NV | Финансово посредничество | EUR | 2 495 | 3.97% |
| 11.18. | Kraft Foods | Хранителна промишленост | EUR | 287 | 0.46% |
| 11.19. | Lafarge | Добивна промишленост | EUR | 268 | 0.43% |
| 11.20. | Metro | Търговско посредничество | EUR | 302 | 0.48% |
| 11.21. | Michelin Luxembourg SCS | Производство на външни и вътрешни гуми | EUR | 157 | 0.25% |
| 11.22. | OMV AG | Производство и разпределение на електрическа и топлинна енергия и на газообразни горива | EUR | 144 | 0.23% |
| 11.23. | PPR | Търговско посредничество | EUR | 278 | 0.44% |
| 11.24. | Procter & Gamble Co | Производство на лекарствени вещества и продукти | EUR | 224 | 0.36% |
| 11.25. | Repsol International Finance BV | Производство и разпределение на електрическа и топлинна енергия и на газообразни горива | EUR | 245 | 0.39% |
| 11.26. | Rhodia | Преработваща промишленост | EUR | 147 | 0.23% |
| 11.27. | Shell International Finance BV | Производство и разпределение на електрическа и топлинна енергия и на газообразни горива | EUR | 117 | 0.19% |
| 11.28. | St. Gobain | Добивна промишленост | EUR | 305 | 0.48% |
| 11.29. | Statoil ASA | Производство и разпределение на електрическа и топлинна енергия и на газообразни горива | EUR | 216 | 0.34% |
| 11.30. | Stena | Транспорт, складиране и съобщения | EUR | 335 | 0.53% |

| № по ред | НАИМЕНОВАНИЕ НА ЕМИТЕНТА | Вид икономическа дейност на емитента* | Код на валута | към 31.12.2010 г. | |
|----------|---|---|---------------|---|--|
| | | | | Стойност на дълговите ценни книжа /в хил. лева/ | Относителен дял от активите на фонда /в %/ |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| 11.31. | Telecom Italia | Транспорт, складиране и съобщения | EUR | 210 | 0.33% |
| 11.32. | Telekom Finanzmanagement GmbH | Далекосъобщения | EUR | 146 | 0.23% |
| 11.33. | Telenor | Транспорт, складиране и съобщения | EUR | 215 | 0.34% |
| 11.34. | Total Capital SA | Производство и разпределение на електрическа и топлинна енергия и на газообразни горива | EUR | 112 | 0.18% |
| 11.35. | Toyota Motor Credit Corp | Производство на автомобили, ремаркета и полуремаркета | EUR | 121 | 0.19% |
| 11.36. | Transneft (TransCapitalInvest) | Производство и разпределение на електрическа и топлинна енергия и на газообразни горива | EUR | 250 | 0.40% |
| 11.37. | Versatel | Транспорт, складиране и съобщения | EUR | 186 | 0.30% |
| 11.38. | Volkswagen International Finance NV | Производство на автомобили, ремаркета и полуремаркета | EUR | 242 | 0.38% |
| 11.39. | Volvo Treasury | Финансово посредничество | EUR | 306 | 0.49% |
| 12 | Квалифицирани дългови ценни книжа**, издадени от чуждестранни общини, приети за търговия на регулирани пазари на ценни книжа в държави, посочени в наредба на КФН - общо, в т.ч.: | | | - | 0.00% |
| 13 | Квалифицирани дългови ценни книжа**, извън посочените в т. 7, 8, 9 и 12, приети за търговия на регулирани пазари на ценни книжа в държави, посочени в наредба на КФН - общо, в т.ч.: | | | - | 0.00% |
| | ОБЩО | | | 32 486 | 51.64% |

Забележки:

* Видът на икономическа дейност на емитента е посочен съгласно последната утвърдена от председателя на НСИ Национална класификация на икономическите дейности:сектори и подсектори

**Квалифицирани дългови ценни книжа са дългови ценни книжа с инвестиционен кредитен рейтинг, присъден от международно призната рейтингова агенция.