

ИНФОРМАЦИЯ

СЪГЛАСНО ИЗИСКВАНИЯТА НА ЧЛ. 72, АЛ. 2 ОТ НАРЕДБА № 44,

ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ ФИНАНСИ”
(ПРЕДИШНО НАИМЕНОВАНИЕ СТАТУС ФИНАНСИ)

ИЗГОТВЕНА ОТ УД „СКАЙ УПРАВЛЕНИЕ НА АКТИВИ” АД

ЗА ПЕРИОДА ОТ 01.6.2014 Г. ДО 30.6.2014 Г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на месец юни нетните активи на фонда 1 730 222.8106 лв., което представлява намаление от -58 373.2682 лв. спрямо края на месец май. Броят на емитираните дялове намалява с -27 715.9840 и достига 4 322 375.0445.



Горната графика представя движението на индекса CECE BNK представящ движението на акции на банки от Източна Европа, съчетан с движението на Скай Финанси.

През юни продължи възходящото движение на развитите пазари. Изявената подкрепа от ЕЦБ и очакванията за все още далечно повишение на основните лихви в САЩ, въздействаха позитивно на развитите пазари. При развиващите се пазари се получи известно движение на две скорости. Геополитическите проблеми в Украйна и надигането и бързото завземане на значителна територия от ислямистите в Ирак, повлияха негативно на пазарите съответно в Източна Европа и Турция. В същото време, българския пазар за пореден път бе хванат натясно от недотам адекватни действия на политици. Въпреки че, на развити икономики политическите избори рядко оказват кой знае колко силно влияние на пазарите, в България значимостта на изборите се приближава по-скоро до развиващите се пазари от Азия и Латинска Америка. От тази гледна точка, не очакваме възходящия тренд в България да се възобнови трайно преди изборите. Поради тази причина и намалихме до известна степен експозицията към България в ДФ Скай Нови Акции и ДФ Скай Финанси.

Изменение	Q1 2013	Q2 2013	Q3 2013	Q4 2013	Q1 2014	Q2 2014	Юни 2014
ДФ Скай Финанси	-0.84%	-5.58%	6.63%	2.68%	3.31%	-2.7%	1.9%
CECE Banking Financial Index	-5.6%	-1.6%	10.6%	4.04%	3.7%	-3.9%	-5.47%

Стандартно отклонение

	Стандартно отклонение
ДФ Скай Финанси	13.62%
CECE Banking Financial Index	20.52%

Стойност на портфейла в началото и в края на отчетния период в лева

Активи	30.4.2014	31.5.2014	30.6.2014	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	1 480 707	1 496 220	1 424 883	82.11%
Облигации	-	-	-	-
Парични средства	245 403	288 184	302 583	17.44%
Депозити до 3 мес.	0	0	0	0.00%
Вземания	3 349	8 373	6 743	0.39%
Други	1 457	1 202	1 033	0.06%
Общо:	1 730 915	1 793 978	1 735 243	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “Скай Финанси” акции

Company	31.5.2014			30.6.2014			
	Брой ценни книжа	Цена за брой ¹	Балансова стойност в лв	Брой ценни книжа	Цена за брой ¹	Балансова стойност в лв	Процент от активите
София Комерс -заложни къщи АД	1825	5.8	10669.0	1825	5.9	10789.4	0.6%
Българска фондова борса-София АД	12647	4.7	58821.2	6647	3.8	25012.7	1.4%
CROATIA OSIGURANJE D.D.	19	7300.0	35759.8	19	7305.2	35832.4	2.1%
JADRANSKO OSIGURANJE D.D.	29	2955.0	22094.0	29	3000.0	22460.0	1.3%
Privredna Banka Zagreb D.D.	395	420.0	42772.5	395	451.0	45990.1	2.7%
ZAGREBACHKA BANKA D.D.	4025	30.7	31858.3	4025	34.6	35900.8	2.1%
SIF Banat Crisana	130500	1.1	65620.5	130500	1.2	70112.7	4.0%
SIF MOLDOVA BACAU	80000	1.2	44242.7	80000	1.4	48549.9	2.8%
SIF OLTENIA CRAIOVA	45000	1.9	36980.0	45000	1.9	37972.0	2.2%
Agrobanka a.d. Beograd	121	0.0	0.0	121	0.0	0.0	0.0%
AIK banka a.d. Niš	1282	1611.0	34927.0	1282	1604.0	34735.2	2.0%
Dunav Osigurianje A.D.	258	843.0	3678.1	258	849.0	3700.0	0.2%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	950	1743.0	28002.6	950	1750.0	28082.7	1.6%
Metals Banka AD Novi Sad	105	0.0	0.0	105	0.0	0.0	0.0%
T. Garanti Bankasi	10500	8.6	61612.9	10500	8.3	58768.1	3.4%
İŞ BANKASI (C)	8400	6.0	34416.8	8400	5.7	32496.1	1.9%

¹ Цени в съответната валута

Haci Omer Sabanci Holding	7000	10.2	49002.1	7000	9.9	46740.4	2.7%
YAPI VE KREDI BANK	10000	4.9	33560.3	10000	4.6	31191.8	1.8%
Erste Bank AG	1446	25.5	72089.0	1446	23.6	66800.4	3.8%
Raiffeisen International Bank-Hold. AG	1750	24.6	84095.8	1750	23.3	79800.3	4.6%
KBC	1750	43.7	149469.4	1750	39.8	136052.4	7.8%
Deutsche Bank AG	450	29.7	26152.9	450	25.7	22614.8	1.3%
NBG	120	2.6	614.9	120	2.7	626.7	0.0%
Piraeus Bank S.A.	347	1.8	1221.6	347	1.6	1099.5	0.1%
BANCO SANTANDER SA ORD	6284	7.5	92473.2	6284	7.6	93776.0	5.4%
BANCO BILBAO VISCAYA ARGENTARIA	7479	9.4	137558.4	7479	9.3	136168.8	7.8%
Intesa Sanpaolo	12000	2.5	57689.2	12000	2.3	53035.1	3.1%
SHS UNICREDIT SPA ORD REG	9000	6.4	112567.8	9211	6.1	109847.4	6.3%
HSBC HOLDINGS	2400	6.3	36323.5	2400	5.9	34723.2	2.0%
STANDARD CHARTERED	1150	13.4	37136.4	1150	11.9	33506.5	1.9%
BNP Paribas	450	51.4	45211.9	450	49.5	43605.7	2.5%
SHS SOCIETE GENERALE	600	42.3	49597.9	600	38.3	44892.2	2.6%
Total:			1496219.7			1424883.4	82.1%

Сделки с деривати и хеджиращи сделки

Фонда не притежава деривативни инструменти и не са сключвани сделки с такива. Не са сключвани хеджиращи сделки и няма отворена хеджираща позиция.

Дата на съставяне:
09.7.2014 г.

Съставил:
Иван Иванов: