

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 01.12.2013 Г. ДО 31.12.2013 Г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на месец декември нетните активи на фонда са 1 652 436.9605 лв., което представлява намаление от -39 564.0002 лв. спрямо края на месец ноември. Броят на емитираните дялове се увеличава с 212.2579 и достига 4 352 286.2963.



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

През декември ФЕД реши да започне намаляването на паричните стимули от януари 2014, самото решение не предизвика силна пазарна реакция на пазарите. Въпреки това декември се оказа негативен месец за развиващите се пазари, като MSCI EM измерен в евро завърши месеца със спад от 2,7%. Особено негативен бе месеца за турския пазар, където несигурността около промяната в паричната политика в САЩ бе допълнена с несигурност, породена от местни политически конфликти вътре в управляващата партия. Спадът на борсовите индекси бе допълнително подхранен и от спад на турската лира, която намали стойността си с над 6% спрямо еврото. Така от основните развиващи се пазари турския се оказа най-поевтиняващия – измерено в евро MSCI Турция реализира спад от 16.1% за месеца и над 40% под локалния си връх от пролетта на 2013 г. като по този начин се върна на равнищата си от началото на 2012г. Все пак турския пазар е един от най-волатилните сред развиващите се пазари и движения от +-30% на годишна база реално се случиха през всяка от последните седем години години.

Действителното осъществяване на намаляването на паричните стимули бе отложено за 2014, като и тогава ще може да се наблюдава как и дали реално ще въздейства на пазарите. В същото време икономиките от ЕС една след друга излизат от рецесия, като през 2013 Великобритания последва САЩ и реализира изненадващ ръст. Южна Европа все още е спирачка за растежа, но със спадането на лихвите на ДЦК в Испания и Италия, където достигнаха равнища от под 4% при над 7% на върха на кризата, може да се очаква, че 2014 ще е по-добра и за икономиките на стария континент.

Изменение	Q3 2012	Q4 2012	Q1 2013	Q2 2013	Q3 2013	Q4 2013	Декември 2013
ДФ Скай Финанси	3.58%	11.33%	-0.84%	-5.58%	6.63%	2.68%	-2.34%
CECE Banking Financial Index	9.4%	13.8%	-5.6%	-1.6%	10.6%	4.04%	-3.27%

Стандартно отклонение

	Стандартно отклонение
ДФ Скай Финанси	14.28%
CECE Banking Financial Index	19.48%

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

Активи	31.10.2013	30.11.2013	31.12.2013	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	1 345 660	1 349 250	1 316 828	79.34%
Облигации	-	-	-	-
Парични средства	251 774	141 572	139 669	8.41%
Депозити до 3 мес.	89 576	200 000	200 000	12.05%
Вземания	3 128	5 518	3 283	0.20%
Други	363	184	0	0.00%
Общо:	1 690 500	1 696 524	1 659 780	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “Скай Финанси” акции

Company	30.11.2013			31.12.2013			
	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	5.6	10221.8	1825	5.6	10249.2	0.6%
Българска фондова борса-София АД	12647	3.3	41709.8	12647	3.4	43278.0	2.6%
CROATIA OSIGURANJE D.D.	19	6100.0	29668.3	19	7100.0	34602.2	2.1%
JADRANSKO OSIGURANJE D.D.	29	2950.0	21899.3	29	2990.0	22241.5	1.3%
Privredna Banka Zagreb D.D.	155	439.0	17417.9	155	435.0	17294.3	1.0%
ZAGREBACHKA BANKA D.D.	2025	26.4	13684.8	2025	29.0	15063.1	0.9%
SIF MOLDOVA BACAU	80000	1.4	50692.5	80000	1.5	51447.3	3.1%
SIF OLTENIA CRAIOVA	45000	1.9	37477.4	45000	2.0	39058.0	2.4%
Agrobanka a.d. Beograd	121	0.0	0.0	121	0.0	0.0	0.0%
AIK banka a.d. Niš	1282	1505.0	33088.9	1282	1533.0	33528.7	2.0%
Dunav Osigurianje A.D.	258	622.0	2752.1	258	853.0	3754.5	0.2%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	950	1259.0	20512.0	950	1507.0	24424.4	1.5%
Metals Banka AD Novi Sad	105	0.0	0.0	105	0.0	0.0	0.0%
Akbank Turk AS	6000	7.4	31606.5	6000	6.7	26790.4	1.6%
T. Garanti Bankasi	20500	7.6	111199.3	20500	7.0	95085.8	5.7%
İŞ BANKASI (C)	8400	5.2	31094.0	8400	4.7	26030.6	1.6%
Haci Omer Sabanci Holding	7000	9.2	45943.3	7000	8.6	40305.5	2.4%

¹ Цени в съответната валута

Turkiye Halk Bankasia A.S.	2100	15.5	23171.0	2100	12.2	17003.9	1.0%
YAPI VE KREDI BANK	10000	4.3	30681.1	10000	3.7	24791.1	1.5%
Erste Bank AG	1446	25.9	73276.9	1446	25.3	71636.5	4.3%
Raiffeisen International Bank-Hold. AG	500	27.1	26511.3	500	25.6	25054.2	1.5%
KBC	2000	42.0	164289.7	2000	41.3	161356.0	9.7%
Deutsche Bank AG	450	35.5	31235.6	450	34.7	30518.3	1.8%
NBG	120	4.6	1074.9	120	3.9	903.6	0.1%
Piraeus Bank S.A.	347	1.6	1099.5	347	1.5	1038.4	0.1%
BANCO SANTANDER SA ORD	6015	6.5	76973.9	6015	6.5	76538.7	4.6%
BANCO BILBAO VISCAYA ARGENTARIA	7336	8.8	126176.0	7336	8.9	128385.6	7.7%
Intesa Sanpaolo	12000	1.8	42041.7	12000	1.8	42133.3	2.5%
SHS UNICREDIT SPA ORD REG	14700	5.4	155443.5	14700	5.4	154911.7	9.3%
BNP Paribas	450	55.3	48626.8	450	56.7	49859.0	3.0%
SHS SOCIETE GENERALE	600	42.3	49680.0	600	42.2	49545.1	3.0%
Total:			1349249.9			1316828.5	79.3%

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:
10.1.2014 г.

Съставил:
Иван Иванов: