

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 01.5.2014 Г. ДО 31.5.2014 Г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на месец май нетните активи на фонда 1 788 596.0788 лв., което представлява увеличение от 62 579.5562 лв. спрямо края на месец април. Броят на емитираните дялове се увеличава с 615.6170 и достига 4 350 091.0285.



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

Месец май бе доминиран от очакваните действия на ЕЦБ за избягване на дългосрочна ниска инфлация. Решенията бяха взети в началото на юни, но очакванията за провеждане на експанзивна политика и в Еврозоната повишиха настроението на пазарите седмици преди това. На пръв поглед изглежда че подобно решение е до известна степен закъсняло – повечето европейски икономики вече се отласкват от дъното. Но в същото време основната заплаха за Еврозоната е навлизане в японския сценарии от последните 20 години. Ниска инфлация или дори дефлация вкарани и в дългосрочните очаквания на икономическите субекти. Заедно със свързаните с това ниски стимули за инвестиране, нисък растеж, поскъпваща валута. От тази гледна точка действията на ЕЦБ са на място, тъй като мандата на централната банка е свързан с инфлация, а не с растеж. По този начин стимулиращите действия от страна на ЕЦБ могат да бъдат преглътнати политически по-лесно от северните държави.

Изменение	Q4 2012	Q1 2013	Q2 2013	Q3 2013	Q4 2013	Q1 2014	Май 2014
ДФ Скай Финанси	11.33%	-0.84%	-5.58%	6.63%	2.68%	3.31%	3.63%
CECE Banking Financial Index	13.8%	-5.6%	-1.6%	10.6%	4.04%	3.7%	4.34%

Стандартно отклонение

	Стандартно отклонение
ДФ Скай Финанси	14.9%
CECE Banking Financial Index	22.13%

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

Активи	31.3.2014	30.4.2014	31.5.2014	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	1 433 795	1 480 707	1 496 220	83.40%
Облигации	-	-	-	-
Парични средства	280 615	245 403	288 184	16.06%
Депозити до 3 мес.	0	0	0	0.00%
Вземания	3 894	3 349	8 373	0.47%
Други	1 635	1 457	1 202	0.07%
Общо:	1 719 939	1 730 915	1 793 978	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “Скай Финанси” акции

Company	30.4.2014			31.5.2014			
	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	5.9	10767.5	1825	5.8	10669.0	0.6%
Българска фондова борса-София АД	12647	4.5	56823.0	12647	4.7	58821.2	3.3%
CROATIA OSIGURANJE D.D.	19	7202.1	35178.9	19	7300.0	35759.8	2.0%
JADRANSKO OSIGURANJE D.D.	29	2650.0	19756.8	29	2955.0	22094.0	1.2%
Privredna Banka Zagreb D.D.	395	435.5	44223.9	395	420.0	42772.5	2.4%
ZAGREBACHKA BANKA D.D.	4025	27.6	28600.6	4025	30.7	31858.3	1.8%
SIF Banat Crisana				130500	1.1	65620.5	3.7%
SIF MOLDOVA BACAU	80000	1.2	42802.5	80000	1.2	44242.7	2.5%
SIF OLTENIA CRAIOVA	45000	1.8	36104.7	45000	1.9	36980.0	2.1%
Agrobanka a.d. Beograd	121	0.0	0.0	121	0.0	0.0	0.0%
AIK banka a.d. Niš	1282	1668.0	36155.6	1282	1611.0	34927.0	1.9%
Dunav Osiguranje A.D.	258	630.0	2748.2	258	843.0	3678.1	0.2%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	950	1700.0	27306.4	950	1743.0	28002.6	1.6%
Metals Banka AD Novi Sad	105	0.0	0.0	105	0.0	0.0	0.0%
Akbank Turk AS	6000	7.4	29489.5				
T. Garanti Bankasi	20500	7.7	105677.3	10500	8.6	61612.9	3.4%
İŞ BANKASI (C)	8400	5.0	27841.0	8400	6.0	34416.8	1.9%

¹ Цени в съответната валута

Haci Omer Sabanci Holding	7000	8.9	41546.7	7000	10.2	49002.1	2.7%
Turkiye Halk Bankasia A.S.	2100	14.1	19746.4				
YAPI VE KREDI BANK	10000	4.4	29276.1	10000	4.9	33560.3	1.9%
Erste Bank AG	1446	24.2	68412.5	1446	25.5	72089.0	4.0%
Raiffeisen International Bank-Hold. AG	750	22.8	33371.4	1750	24.6	84095.8	4.7%
KBC	1750	43.9	150290.9	1750	43.7	149469.4	8.3%
Deutsche Bank AG	450	31.8	27952.7	450	29.7	26152.9	1.5%
NBG	120	2.8	657.2	120	2.6	614.9	0.0%
Piraeus Bank S.A.	347	1.7	1153.7	347	1.8	1221.6	0.1%
BANCO SANTANDER SA ORD	6154	7.2	86263.3	6284	7.5	92473.2	5.2%
BANCO SANTANDER SA rights	6154	0.2	1805.4				
BANCO BILBAO VISCAYA ARGENTARIA	7479	8.8	129381.6	7479	9.4	137558.4	7.7%
Intesa Sanpaolo	12000	2.5	57736.1	12000	2.5	57689.2	3.2%
SHS UNICREDIT SPA ORD REG	12700	6.4	159963.4	9000	6.4	112567.8	6.3%
HSBC HOLDINGS	2400	6.0	34454.9	2400	6.3	36323.5	2.0%
STANDARD CHARTERED	1150	12.8	35022.5	1150	13.4	37136.4	2.1%
BNP Paribas	450	54.1	47623.5	450	51.4	45211.9	2.5%
SHS SOCIETE GENERALE	600	44.8	52572.7	600	42.3	49597.9	2.8%
Total:			1480706.5			1496219.7	83.4%

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:
10.6.2014 г.

Съставил:
Иван Иванов: