

СКАЙ УПРАВЛЕНИЕ НА АКТИВИ АД

ИНФОРМАЦИЯ

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

**ИЗГОТВЕНА ОТ УД „СКАЙ УПРАВЛЕНИЕ НА АКТИВИ” АД
ОТНОСНО ПОРТФЕЙЛА
НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СТАТУС ФИНАНСИ”**

ЗА ПЕРИОДА от 01.6.2013 г. до 30.6.2013 г.

СКАЙ УПРАВЛЕНИЕ НА АКТИВИ АД

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на месец юни нетните активи на фонда са 1 556 279.7400 лв., което представлява намаление от -151 575.0400 лв. спрямо края на месец май. Броят на емитираните дялове остава без промяна на 4 487 076.5540.



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

Опасенията относно времевата рамка, в която ФЕД ще започнат ще намаляват количествените улеснения се материализираха през юни. От една страна съществува несигурност до колко ръста на борсите от последните месеци се дължи на подобрение във фундамента в икономиките, до колко на намаление на риска в Европа, и до колко на наводнението с евтини пари. Страничният ефект от излизането от страна на САЩ от силно експанзивната парична политика, е повишаване на лихвените проценти в САЩ и съответно изтегляне на парични ресурси от развиващите се пазари, което навява спомени от обстоятелствата довели до азиатската криза през 1996 г. Поради тази причина и развиващите се пазари бяха силно засегнати през юни. Ако в последствие не се забележат ликвидни проблеми на развиващите се пазари, може да се очаква, че това оттегляне на пазарни участници от развиващите се пазари ще се обърне. Конкретната времева рамка е по-трудна за определяне, тъй като пазара на облигации в САЩ реално изпревари значително конкретни действия от страна на ФЕД и във времеви хоризонт и като амплитуда на движението, което и доведе до изключителния ръст на волатилността на развиващите се пазари.

СКАЙ УПРАВЛЕНИЕ НА АКТИВИ АД

Изменение	Q2 2012	Q3 2012	Q4 2012	Q1 2013	Q2 2013	Май 2013	Юни 2013
ДФ Статус Финанси	-5.28%	3.58%	11.33%	-0.84%	-5.58%	1.44%	-8.85%
CECE Banking Financial Index	-7%	9.4%	13.8%	-5.6%	-1.6%	4.04%	-7.0%

Стандартно отклонение

	Стандартно отклонение
ДФ Статус Финанси	14.87%
CECE Banking Financial Index	20.01%

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

Активи	30.4.2013	31.5.2013	30.6.2013	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	1 104 983	1 213 092	1 100 138	70.48%
Облигации	-	-	-	-
Парични средства	487 994	396 765	358 582	22.97%
Депозити до 3 мес.	87 378	88 470	88 470	5.67%
Вземания	11 225	12 885	12 535	0.80%
Други	3 084	1 272	1 094	0.07%
Общо:	1 694 664	1 712 483	1 560 819	100.00%

СКАЙ УПРАВЛЕНИЕ НА АКТИВИ АД

Стойност на притежаваните от ДФ “Статус Финанси” акции

Company	31.5.2013			30.6.2013			
	Брой ценни книжа	Цена за брой ¹	Балансова стойност	Брой ценни книжа	Цена заброй	Балансова стойност	Процент от активите
София Комерс - заложни къщи АД	1825	6.0	10858.8	1825	6.0	10877.0	0.7%
Българска фондова борса-София АД				12647	2.7	34665.4	2.2%
Сентинел рапид	17777	1.3	22681.7	17777	1.3	23078.1	1.5%
CROATIA OSIGURANJE D.D.	19	7150.0	35191.9	19	6855.0	34195.2	2.2%
JADRANSKO OSIGURANJE D.D.	29	2900.0	21786.0	29	2815.0	21432.9	1.4%
Privredna Banka Zagreb D.D.	155	510.0	20477.9	155	480.0	19533.4	1.3%
ZAGREBACHKA BANKA D.D.	2025	34.2	17945.8	2025	31.7	16853.4	1.1%
SIF MOLDOVA BACAU	80000	1.3	44966.8	80000	1.2	43498.9	2.8%
SIF OLTENIA CRAIOVA	45000	1.4	28826.9	45000	1.4	28256.8	1.8%
Agrobanka a.d. Beograd	121	0.0	0.0	121	0.0	0.0	0.0%
AIK banka a.d. Niš	1256	1385.0	30483.7	1282	1245.0	27342.0	1.8%
Dunav Osigurianje A.D.	258	620.0	2803.1	258	901.0	3982.2	0.3%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	950	1351.0	22490.9	950	1180.0	19203.4	1.2%
Metals Banka AD Novi Sad	105	0.0	0.0	105	0.0	0.0	0.0%
Akbank Turk AS	6000	8.9	42897.7	6000	7.9	36587.4	2.3%
T. Garanti Bankasi	10500	9.7	81452.9	10500	8.4	68589.8	4.4%
İŞ BANKASI (C)	8400	7.0	46755.7	8400	5.7	37146.0	2.4%

¹ Цени в съответната валута, сума в лева

СКАЙ УПРАВЛЕНИЕ НА АКТИВИ АД

Haci Omer Sabanci Holding	7000	12.0	67177.7	7000	10.2	55121.7	3.5%
Türkiye Halk Bankasia A.S.	2100	20.1	33756.8	2100	16.4	26637.6	1.7%
YAPI VE KREDI BANK	10000	5.6	44785.1	10000	4.4	34058.3	2.2%
Erste Bank AG	1330	25.1	65187.4	1330	20.5	53338.7	3.4%
Raiffeisen International Bank-Hold. AG	500	26.4	25817.0	500	22.4	21905.3	1.4%
KBC	2400	30.7	144058.6	2400	28.6	134271.6	8.6%
Deutsche Bank AG	450	36.1	31750.5	450	32.2	28300.4	1.8%
NBG	120	5.3	1243.9	120	2.5	586.8	0.0%
Piraeus Bank S.A.	3471	0.2	1357.7	347	1.2	834.8	0.1%
BANCO SANTANDER SA ORD	2788	5.5	30208.8	2788	4.9	26729.9	1.7%
BANCO BILBAO VISCAYA ARGENTARIA	7248	7.2	102732.4	7248	6.4	91363.4	5.9%
Intesa Sanpaolo	12000	1.5	34040.8	12000	1.2	28999.5	1.9%
SHS UNICREDIT SPA ORD REG	14700	4.4	125249.6	14700	3.6	104825.1	6.7%
BNP Paribas	450	45.3	39891.6	450	42.0	36943.2	2.4%
SHS SOCIETE GENERALE	600	30.9	36214.2	600	26.4	30980.4	2.0%
Total:			1213091.7			1100138.4	70.5%

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:
10.07.2013 г.

Съставил:

Иван Иванов: