

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 01.9.2013 Г. ДО 30.09.2013 Г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на месец септември нетните активи на фонда са 1 603 869.5205 лв., което представлява увеличение от 11 824.6731 лв. спрямо края на месец август. Броят на емитираните дялове намалява с -150 092.3593 и достигат 4 337 402.0481.



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

Въпреки очакванията, че септември ще бъде един волатилен месец за пазарите, те всъщност се успокоиха. Преекспонирането през август на въздействието на промяната на американската парична политика върху развиващите се пазари създаде впечатление за възможна силна промяна в отношението към развиващите се пазари. В последствие след решението на ФЕД за отлагане на намаляването на паричните стимули на пазарите настана известно успокоение. Валутите на развиващите се пазари реализираха известно поскъпване, а тъй като именно валутните пазари служеха за индикатор за бягство или прилив на капитали, то и капиталовите им пазари се успокоиха.

Политическите проблеми в САЩ постепенно излизат на дневен ред. Желанието на републиканците в конгреса да премахнат Обамакеър/реформи в здравеопазването предприети от Обама с цел по-достъпно здравеопазване в САЩ/ доведе до доста радикални действие от тяхна страна – включително негласуване на нов бюджет и съответно спиране на всички дейности на американското правителство от несъществено значение. Макар че това реално не се отразява пряко на пазарите, е възможно да се отрази в някаква степен на възстановяването на американската икономика и от тук косвено на фондовите пазари. Доста по-сериозна заплаха от страна на републиканците е да не гласуват увеличение на така нар. „таван на дълга“. Въпреки наименованието си, това всъщност представлява упълномощаване от страна на Конгреса за заплащане на вече направени и реално гласувани от Конгреса разходи, а не карт бланш за увеличение на дълга в бъдеще. По този начин негласуването на този „таван на дълга“ заплашва

САЩ да навлезе в технически фалит, поради нежелание за плащане на дълговете си. Това би имало изключително сериозни последици както за американската, така и за световната икономика. Точно поради изключителната сериозност на последициите от подобна заплаха, пазарите реално не вярват, че републиканците ще я осъществят.

Изменение	Q2 2012	Q3 2012	Q4 2012	Q1 2013	Q2 2013	Q3 2013	Септември 2013
ДФ Скай Финанси	-5.28%	3.58%	11.33%	-0.84%	-5.58%	6.63%	4.23%
CECE Banking Financial Index	-7%	9.4%	13.8%	-5.6%	-1.6%	10.6%	0.5%

Стандартно отклонение

	Стандартно отклонение
ДФ Скай Финанси	14.32%
CECE Banking Financial Index	19.32%

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

Активи	31.7.2013	31.8.2013	30.9.2013	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	1 140 519	1 119 161	1 227 412	76.31%
Облигации	-	-	-	-
Парични средства	351 587	382 630	288 098	17.91%
Депозити до 3 мес.	88 470	89 576	89 576	5.57%
Вземания	11 893	4 585	2 852	0.18%
Други	910	725	547	0.03%
Общо:	1 593 379	1 596 677	1 608 484	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “Скай Финанси” акции

Company	31.8.2013			30.9.2013			
	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	5.3	9581.3	1825	5.5	10028.4	0.6%
Българска фондова борса-София АД	12647	2.8	34779.3	12647	2.9	36549.8	2.3%
Сентинел рапид	17777	1.3	23135.0	17777	1.3	23138.6	1.4%
CROATIA OSIGURANJE D.D.	19	6500.0	31915.4	19	6700.0	32694.3	2.0%
JADRANSKO OSIGURANJE D.D.	29	2805.1	21021.9	29	3094.5	23048.0	1.4%
Privredna Banka Zagreb D.D.	155	471.0	18866.2	155	440.0	17515.7	1.1%
ZAGREBACHKA BANKA D.D.	2025	28.3	14825.3	2025	26.0	13522.1	0.8%
SIF MOLDOVA BACAU	80000	1.2	43458.9	80000	1.3	43938.2	2.7%
SIF OLTENIA CRAIOVA	45000	1.5	30383.3	45000	1.6	31757.0	2.0%
Agrobanka a.d. Beograd	121	0.0	0.0	121	0.0	0.0	0.0%
AIK banka a.d. Niš	1282	1474.0	32299.4	1282	1430.0	31286.3	1.9%
Dunav Osigurianje A.D.	258	987.0	4352.6	258	970.0	4270.9	0.3%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	950	1325.0	21515.3	950	1290.0	20914.3	1.3%
Metals Banka AD Novi Sad	105	0.0	0.0	105	0.0	0.0	0.0%
Akbank Turk AS	6000	6.8	29612.6	6000	7.4	31736.9	2.0%
T. Garanti Bankasi	10500	7.0	53809.3	10500	8.0	59421.4	3.7%
İŞ BANKASI (C)	8400	4.8	29228.3	8400	5.3	31890.5	2.0%

¹ Цени в съответната валута

Haci Omer Sabanci Holding	7000	8.7	44331.6	7000	9.8	48572.2	3.0%
Turkiye Halk Bankasia A.S.	2100	13.0	19872.8	2100	14.8	22096.4	1.4%
YAPI VE KREDI BANK	10000	4.1	29554.4	10000	4.5	31992.8	2.0%
Erste Bank AG	1446	24.3	68596.3	1446	23.4	66065.1	4.1%
Raiffeisen International Bank-Hold. AG	500	26.0	25386.7	500	24.2	23655.8	1.5%
KBC	2000	33.3	130180.0	2000	36.3	142051.9	8.8%
Deutsche Bank AG	450	32.8	28832.9	450	33.9	29871.4	1.9%
NBG	120	3.1	718.2	120	3.0	704.1	0.0%
Piraeus Bank S.A.	347	1.1	753.3	347	1.3	848.3	0.1%
BANCO SANTANDER SA ORD	2872	5.3	29995.6	5872	6.0	69229.4	4.3%
BANCO BILBAO VISCAYA ARGENTARIA	7248	7.2	102349.7	7248	8.3	117092.6	7.3%
BANCO BILBAO VISCAYA ARGENTARIA rights				7248	0.5	6946.2	0.4%
Intesa Sanpaolo	12000	1.5	35183.8	12000	1.5	35690.8	2.2%
SHS UNICREDIT SPA ORD REG	14700	4.3	124030.5	14700	4.6	133656.3	8.3%
BNP Paribas	450	47.4	41731.1	450	50.0	44006.2	2.7%
SHS SOCIETE GENERALE	600	33.1	38860.4	600	36.8	43219.9	2.7%
Total:			1119161.0			1227411.7	76.3%

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:
10.10.2013 г.

Съставил:
Иван Иванов: