

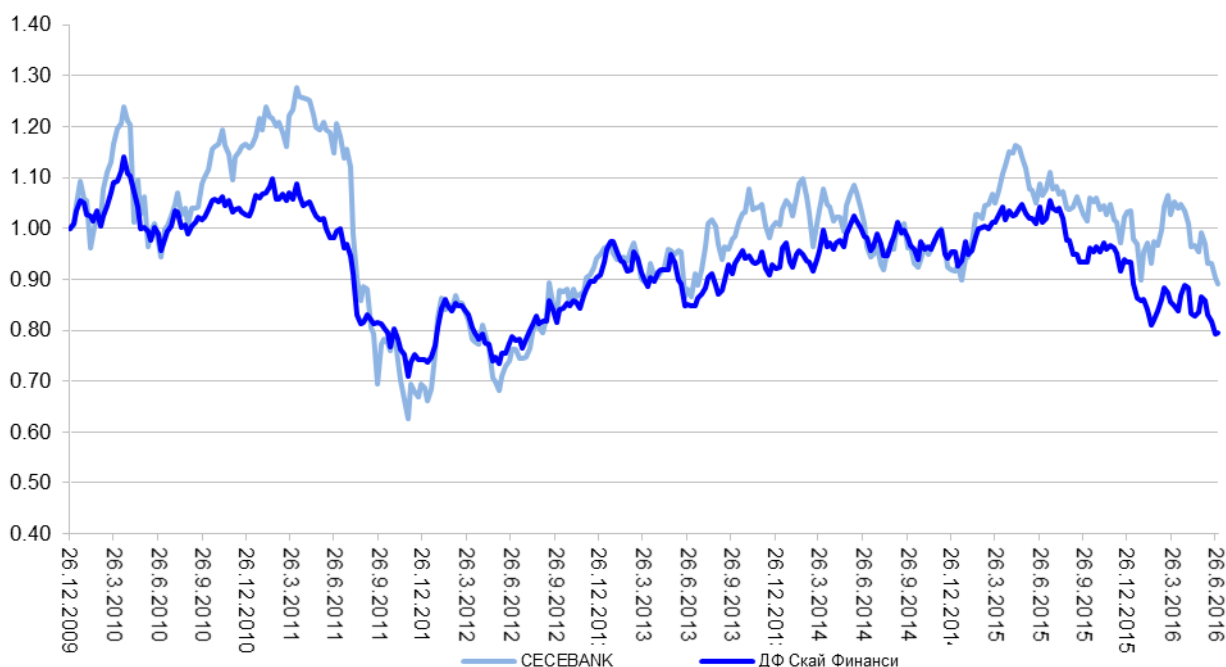
ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ ФИНАНСИ“

01.6.2016 г. - 30.6.2016 г.

Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на месец юни нетните активи на фонда са 1 359 435.55 лв., което представлява намаление от -125 382.68 лв. спрямо края на месец май. Броят на емитираните дялове се увеличава с 592.5383 и достига 4 202 215.7324.

Движението на индекса CECE BNK, представящ движението на акции на банки от Източна Европа, съчетан с движението на ДФ Скай Финанси.



Доминиращата новина през юни бе резултата от референдума за излизане от ЕС във Великобритания. Въпреки, че месеци наред излизаха проучвания които показваха, че резултата при всички положения ще е доста оспорван, пазарите реално не калкулираха излизане. Поради това и шоките вълни се оказаха доста силни. Основните губещи от това решение на Обединеното кралство бяха фокусираните към британския пазар компании, финансовия сектор в Европа и до някъде цикличните европейски компании. Ефектите върху развиващите се пазари извън тези от Централна Европа, бяха реално никакви, като Азия и Латинска Америка дори отбелязаха прилични растежи.

Все пак ефектите през следващите месеци са до известна степен непредсказуеми. От една страна не е напълно сигурно, че Великобритания ще излезе. За това е нужно и решение на парламента и. От друга страна, евентуално икономическо напрежение е възможно да доведе до повече стимули от централните банки, като нетния ефект върху пазарите е трудно да се предвиди и като амплитуда и като посока.

Представяне на фонда по периоди

Изменение	Q4 2014	Q1 2015	Q2 2015	Q3 2015	Q4 2015	Q1 2016	Q2 2016	Юни 2016
ДФ Скай Финанси	-2.53%	7.09%	-0.9%	-7.79%	0.34%	-8.84%	-6.91%	-8.46%
CECE Banking Financial Index	-5%	14.6%	1.2%	-5.1%	1.1%	2.5%	-15.2%	-8.15%

Стандартно отклонение

	Стандартно отклонение
ДФ Скай Финанси	16.12%
CECE Banking Financial Index	20.61%

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

Активи	30.4.2016	31.5.2016	30.6.2016	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	1 335 636	1 321 978	1 188 086	87.15%
Облигации	-	-	-	-
Парични средства	161 775	163 412	173 779	12.75%
Депозити до 3 мес.	0	0	0	0.00%
Вземания	933	2 312	423	0.03%
Други	1 372	1 199	1 031	0.08%
Общо:	1 499 716	1 488 902	1 363 319	100.00%

Информация за паричните средства

Към 30.6.2016 г. Фонда няма депозити. Паричните средства са по сметки на Фонда в банката-депозитар Юробанк България АД.

Стойност на притежаваните от ДФ “Скай Финанси” акции

Company	31.05.2016			30.06.2016			
	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
YAPI VE KREDI BANK	10000	4.130	24532	10000	3.980	24280	1.78%
Haci Omer Sabanci Holding	7000	9.190	38211	7000	9.420	40227	2.95%
İŞ BANKASI (C)	8400	4.510	22503	8400	4.560	23367	1.71%
T. Garanti Bankasi	10500	7.560	47151	10500	7.580	48554	3.56%
ZAVAROVALNICA TRIGLAV	1500	26.000	76277	1500	22.380	65657	4.82%
Metals Banka AD Novi Sad	105	0.005	0	105	0.005	0	0.00%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	950	1450.000	21886	950	1425.000	21472	1.57%
Dunav Osiguranje A.D.	258	900.000	3689	258	900.000	3683	0.27%
AIK banka a.d. Niš	1282	1800.000	36663	1282	1750.000	35584	2.61%
Agrobanka a.d. Beograd	121	0.005	0	121	0.005	0	0.00%
SIF OLTENIA CRAIOVA	45000	1.380	26926	45000	1.522	29614	2.17%
SIF MOLDOVA BACAU	160000	0.719	49880	160000	0.710	49118	3.60%
SIF Banat Crisana SA /SIF 1/	130500	1.456	82385	130500	1.430	80689	5.92%
NN GROUP	1000	30.015	58704	1000	24.795	48495	3.56%
SHS UNICREDIT SPA ORD REG	6610	2.920	37745	6610	1.917	24778	1.82%
Intesa Sanpaolo	12000	2.330	54678	12000	1.645	38603	2.83%
ISHARES JPM EMERG BOND	300	98.670	57895	300	102.100	59907	4.39%

¹ Цени в съответната валута

ZAGREBACHKA BANKA D.D.	4025	39.250	41256	4025	39.000	40783	2.99%
Privredna Banka Zagreb D.D.	395	604.900	62396	395	587.050	60245	4.42%
JADRANSKO OSIGURANJE D.D.	29	2840.000	21508	29	2775.000	20908	1.53%
CROATIA OSIGURANJE D.D.	19	6570.000	32598	19	5500.000	27150	1.99%
PIRAEUS BANK S.A	3	0.271	2	3	0.161	1	0.00%
NATIONAL BANK OF GREECE	8	0.287	4	8	0.192	3	0.00%
HSBC HOLDINGS PLC	2400	4.451	27421	2400	4.659	26460	1.94%
STANDARD CHARTERED PLC	1150	5.293	15626	1150	5.646	15365	1.13%
BNP Paribas	450	49.765	43799	450	39.755	34989	2.57%
SHS SOCIETE GENERALE	600	36.990	43408	600	28.210	33104	2.43%
BANCO SANTANDER SA ORD	6910	4.291	57992	6910	3.429	46342	3.40%
BANCO BILBAO VISCAYA ARGENTARIA	5395	5.961	62899	5395	5.064	53434	3.92%
Deutsche Bank AG	450	16.060	14135	450	12.330	10852	0.80%
СОФИЯ КОМЕРС - ЗАЛОЖНИ КЪЩИ АД	1825	3.556	6490	1825	3.907	7130	0.52%
Българска фондова борса-София АД	6647	2.115	14058	6647	2.081	13832	1.01%
KBC	1250	53.210	130087	1250	43.920	107375	7.88%
Erste Bank AG	1446	24.050	68017	1446	20.310	57439	4.21%
Raiffeisen International Bank-Hold. AG	1750	12.025	41158	1750	11.275	38591	2.83%
СОФИЯ КОМЕРС - ЗАЛОЖНИ КЪЩИ АД				1825	0.030	55	0.00%
Total:			1321978.4			1188086.3	87.15%

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:

08.7.2016 г.

Съставил:

Иван Иванов

Инвеститорите следва да имат предвид, че стойността на дяловете на договорния фонд и доходът от тях може да се понижат. Печалбата не е гарантирана и инвеститорите поемат риска да не възстановят целия размер на инвестициите си. Инвестициите в договорни фондове не са гарантирани от гаранционен фонд, създаден от държавата или друг вид гаранция. Предишните резултати от дейността на фондовете нямат по необходимост връзка с бъдещите такива. Проспектът, документа с ключова информация за инвеститорите и правилата на организираните и управлявани от УД СКАЙ Управление на активи АД договорни фондове, както и друга информация са достъпни в офиса и на интернет страницата на дружеството.