

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 01.2.2014 Г. ДО 28.2.2014 Г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на месец февруари нетните активи на фонда са 1 672 483.03 лв., което представлява увеличение от 22 166.5770лв. спрямо края на месец януари. Броят на емитираните дялове намалява с -5 600.2704 и достига 4 373 112.83.



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

През февруари натиска върху валутите и пазарите от така наречените „Крехки пет“ – Индия, Индонезия, Турция, Южна Африка и Бразилия намаля, след като и Турция повиши лихвите си в края на януари. Като Индонезия и Южна Африка се оказаха между най-поскъпващите основни развиващи се пазари през месеца. На хоризонта обаче се появи друга криза – тази в Украйна. Въпреки че икономиката на Украйна е сравнително малка и слабо интегрирана в световните финанси, участието на Русия в този конфликт променя значително мащаба му. Евентуална ескалация на напрежението и вероятността от налагане на търговски или икономически санкции срещу Русия, прави възможно пренасяне и на икономически проблеми върху икономиките на държавите от ЕС и особено върху тези, които са силно зависими от руски газ или разчитат на руски пазари.

В същото време евентуално увеличение на военната кампания на Русия, която за момента е ограничена само до Крим, прави възможни, макар и към момента доста слабо вероятни значителни негативни последици.

| Изменение | Q4 2012 | Q1 2013 | Q2 2013 | Q3 2013 | Q4 2013 | Януари 2013 | Февруари 2013 |
|------------------------------|---------|---------|---------|---------|---------|-------------|---------------|
| ДФ Скай Финанси | 11.33% | -0.84% | -5.58% | 6.63% | 2.68% | -0.7% | 1.46% |
| CECE Banking Financial Index | 13.8% | -5.6% | -1.6% | 10.6% | 4.04% | 1.5% | 3.59% |

Стандартно отклонение

| | Стандартно отклонение |
|------------------------------|-----------------------|
| ДФ Скай Финанси | 14.8% |
| CECE Banking Financial Index | 20.29% |

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

| Активи | 31.12.2013 | 31.1.2014 | 28.2.2014 | Структура на активите спрямо общата им стойност /%/ |
|--------------------|------------|-----------|-----------|---|
| Акции и права | 1 316 828 | 1 260 811 | 1 317 267 | 78.54% |
| Облигации | - | - | - | - |
| Парични средства | 139 669 | 190 042 | 359 506 | 21.43% |
| Депозити до 3 мес. | 200 000 | 200 000 | 0 | 0.00% |
| Вземания | 3 283 | 3 949 | 0 | 0.00% |
| Други | 0 | 522 | 478 | 0.03% |
| <i>Общо:</i> | 1 659 780 | 1 655 323 | 1 677 251 | 100.00% |

Стойност на притежаваните от ДФ “Скай Финанси” акции

| Сотрану | 31.1.2014 | | | 28.2.2014 | | | |
|----------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------|---------------------|
| | 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 | 5.7 | 10311.3 | 1825 | 5.8 | 10585.0 | 0.6% |
| Българска фондова борса-София АД | 12647 | 3.8 | 47426.3 | 12647 | 3.9 | 48766.8 | 2.9% |
| CROATIA OSIGURANJE D.D. | 19 | 7119.0 | 34574.6 | 19 | 7116.1 | 34570.3 | 2.1% |

¹ Цени в съответната валута

| | | | | | | | |
|---|-------|--------|----------|-------|--------|----------|------|
| JADRANSKO OSIGURANJE D.D. | 29 | 3133.3 | 23226.8 | 29 | 2950.0 | 21874.0 | 1.3% |
| Privredna Banka Zagreb D.D. | 155 | 440.0 | 17432.9 | 155 | 460.0 | 18230.5 | 1.1% |
| ZAGREBACHKA BANKA D.D. | 2025 | 26.7 | 13794.5 | 4025 | 26.3 | 27066.4 | 1.6% |
| SIF MOLDOVA BACAU | 80000 | 1.4 | 47312.8 | 80000 | 1.4 | 47963.8 | 2.9% |
| SIF OLTENIA CRAIOVA | 45000 | 1.9 | 36816.2 | 45000 | 2.0 | 38162.5 | 2.5% |
| Agrobanka a.d. Beograd | 121 | 0.0 | 0.0 | 121 | 0.0 | 0.0 | 0.0% |
| AIK banka a.d. Niš | 1282 | 1642.0 | 35515.7 | 1282 | 1479.0 | 31986.8 | 1.9% |
| Dunav Osiguranje A.D. | 258 | 604.0 | 2629.2 | 258 | 700.0 | 3046.7 | 0.2% |
| KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD | 950 | 1650.0 | 26446.4 | 950 | 1700.0 | 27245.0 | 1.6% |
| Metals Banka AD Novi Sad | 105 | 0.0 | 0.0 | 105 | 0.0 | 0.0 | 0.0% |
| Akbank Turk AS | 6000 | 5.8 | 21987.4 | 6000 | 5.7 | 21968.3 | 1.3% |
| T. Garanti Bankasi | 20500 | 6.0 | 77731.9 | 20500 | 6.1 | 79519.8 | 4.7% |
| İŞ BANKASI (C) | 8400 | 4.1 | 21643.8 | 8400 | 4.1 | 21991.3 | 1.3% |
| Haci Omer Sabanci Holding | 7000 | 7.5 | 33267.3 | 7000 | 7.8 | 35083.9 | 2.1% |
| Türkiye Halk Bankasia A.S. | 2100 | 11.2 | 14896.8 | 2100 | 10.9 | 14584.7 | 0.9% |
| YAPI VE KREDI BANK | 10000 | 3.2 | 20231.4 | 10000 | 3.3 | 21187.3 | 1.3% |
| Erste Bank AG | 1446 | 27.0 | 76373.7 | 1446 | 25.7 | 72711.2 | 4.3% |
| Raiffeisen International Bank-Hold. AG | 500 | 28.5 | 27870.6 | 750 | 25.3 | 37038.5 | 2.2% |
| Raiffeisen International Bank-Hold. AG rights | 500 | 0.9 | 863.8 | | | | |
| KBC | 1750 | 43.9 | 150102.6 | 1750 | 46.0 | 157375.9 | 9.4% |
| Deutsche Bank AG | 450 | 35.9 | 31587.6 | 450 | 35.2 | 31015.6 | 1.8% |

| | | | | | | | |
|------------------------------------|-------|------|-----------|-------|------|-----------|-------|
| NBG | 120 | 3.3 | 772.2 | 120 | 3.6 | 835.5 | 0.0% |
| Piraeus Bank S.A. | 347 | 1.7 | 1174.1 | 347 | 2.0 | 1357.4 | 0.1% |
| BANCO SANTANDER SA ORD | 6015 | 6.4 | 75409.3 | 6154 | 6.6 | 79029.5 | 4.7% |
| BANCO SANTANDER SA ORD - rights | 5977 | 0.1 | 1741.8 | | | | |
| BANCO BILBAO VISCAYA ARGENTARIA | 7336 | 8.9 | 127123.0 | 7336 | 9.0 | 129060.0 | 7.7% |
| Intesa Sanpaolo | 12000 | 2.0 | 46010.5 | 12000 | 2.2 | 52713.5 | 3.1% |
| SHS UNICREDIT SPA ORD REG | 12700 | 5.5 | 136592.4 | 12700 | 5.8 | 143197.1 | 8.5% |
| BNP Paribas | 450 | 57.5 | 50563.1 | 450 | 59.5 | 52332.1 | 3.1% |
| SHS SOCIETE GENERALE | 600 | 42.1 | 49380.8 | 600 | 48.4 | 56768.0 | 3.4% |
| Total: | | | 1260810.6 | | | 1317267.5 | 78.5% |

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:
10.3.2014 г.

Съставил:
Иван Иванов: