

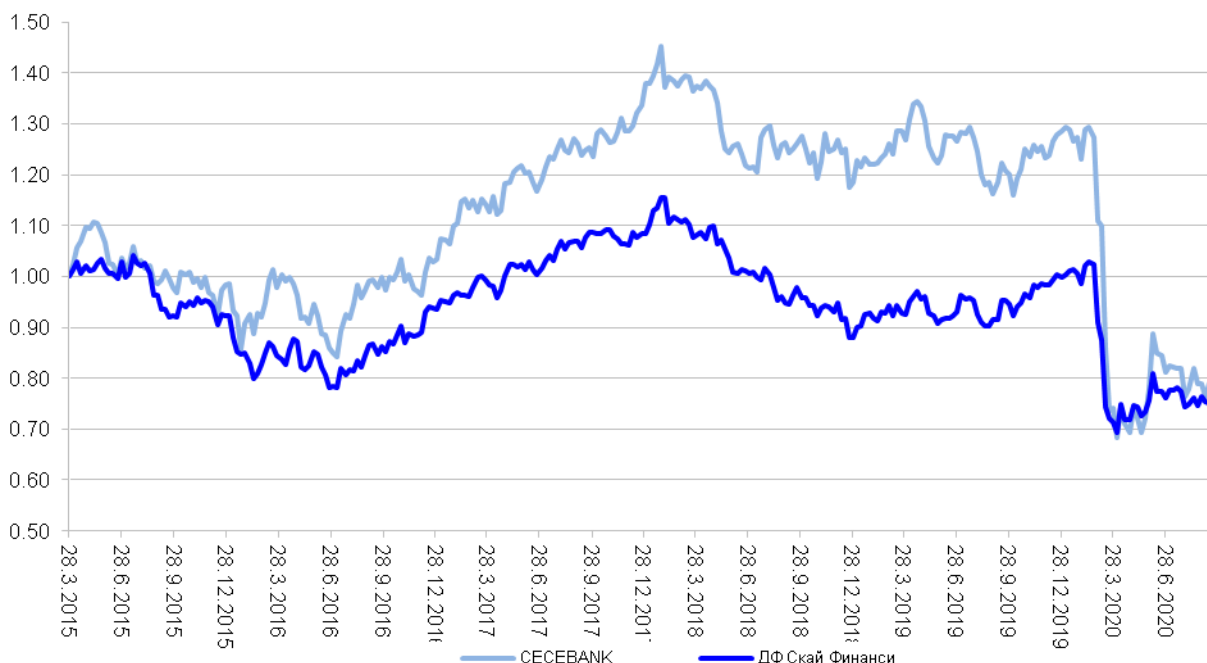
## ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ ФИНАНСИ“

01.9.2020 г. - 30.9.2020 г.

### Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на месец септември нетните активи на фонда са 1 157 686.01 лв., което представлява намаление от 61 066.66 лв. спрямо края на месец август. Броят на емитираните дялове остава без промяна на 3 912 326.5898.

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



С идването на есента, по-хладното време изглежда се прехвърли и върху пазарите. Септември традиционно не е особено богат на новини. Отчетите на компаниите предстои да излязат следващия месец. Основните икономически данни са на тримечие и също са далеч във времето. Така пазарите се фокусират върху неща извън икономиката и финансите. В случая, върху повишаващите се случаи на COVID-19. Макар да липсва значителната паника от март и вече да са известни доста повече неща както за вируса, така и какви мерки да се използват, негативните новини около пандемията неизбежно достигат до съзнанието на пазарните участници.

От една страна не се реализират най-плашещите сценарии за пандемията и за предзвонения от нея спад на икономиките, но от друга страна липсата на яснота за това, кога реално ще бъде преодоляна, намалява очаквания растеж и за следващата година. Ако през юли очакванията за американската икономика бяха за 5.4% спад за 2020 г. и ръст от 4.5% за следващата, към края на септември вече очакванията са съответно за 5% спад за тази година и 4.1% ръст за следващата. Очакванията за V-образно възстановяване изглеждат все по-малко вероятни, а липсата на нови силни стимули също ограничават растежа на пазарите.

**Представяне на фонда по периоди**

Изменение	Q1 2019	Q2 2019	Q3 2019	Q4 2019	Q1 2020	Q2 2020	Q3 2020	Септември 2020
ДФ Скай Финанси	5.16%	0.55%	1.56%	5.50%	-27.91%	6.73%	-6.7%	-5.0%
CECE Banking Financial Index	6.9%	-0.2%	-5.8%	7.8%	-43.6%	11.7%	-11.2%	-7.89%

**Стандартно отклонение**

	Стандартно отклонение
ДФ Скай Финанси	26.10%
CECE Banking Financial Index	40.96%

Стандартното отклонение е измерено на седмична база за последните 52 седмици

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

Активи	31.7.2020	31.8.2020	30.9.2020	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	994 785	1 011 652	949 664	81.67%
Облигации	0	0	0	-
Парични средства	211 764	208 020	212 518	18.28%
Депозити до 3 мес.	0	0	0	0.00%
Вземания	0	3 559	0	0.00%
Други	940	749	565	0.05%
Общо:	1 207 490	1 223 981	1 162 747	100.00%

**Информация за паричните средства**

Към 30.9.2020 г. Фондът няма депозити. Паричните средства са по сметки на Фонда в банката-депозитар Юробанк България АД.

**Стойност на притежаваните от ДФ “Скай Финанси” финансови инструменти**

Company	31.8.2020			30.9.2020			
	Брой ценни книжа	Цена за брой <sup>1</sup>	Балансова стойност в лв	Брой ценни книжа	Цена за брой <sup>1</sup>	Балансова стойност в лв	Процент от активите
YAPI VE KREDI BANK	19431	2.030	8790	19431	2.130	8896	0.77%
HACI OMER SABANCI HOLDING	7000	7.730	12058	7000	8.320	12519	1.08%
T. GARANTI BANKASI	10500	6.760	15817	10500	7.100	16025	1.38%
ZAVAROVALNICA TRIGLAV	1500	28.000	82145	1500	27.300	80091	6.89%
METALS BANKA AD NOVI SAD	105	0.005	0	105	0.005	0	0.00%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	950	2650.000	41872	950	2650.000	41876	3.60%
DUNAV OSIGURIANJE A.D.	258	3001.000	12878	258	3051.000	13094	1.13%
AGROBANKA A.D. BEOGRAD	121	0.005	0	121	0.005	0	0.00%
SIF OLTENIA CRAIOVA	45000	2.020	36734	45000	1.950	35223	3.03%
SIF MOLDOVA BACAU	101845	1.300	53504	101845	1.280	52327	4.50%
SIF BANAT CRISANA SA /SIF 1/	60500	2.200	53788	60500	2.070	50270	4.32%
NN GROUP	1415	31.550	87315	1518	32.050	95155	8.18%
SHS UNICREDIT SPA ORD REG	2377	8.386	38986	2377	7.064	32840	2.82%
INTESA SANPAOLO	12000	1.819	42680	12000	1.608	37730	3.24%
JADRANSKO OSIGURANJE D.D.	29	4120.000	31042	29	3740.000	28072	2.41%
CROATIA OSIGURANJE D.D.	19	6200.000	30605	19	6200.000	30490	2.62%
HSBC HOLDINGS PLC	2400	3.302	17295	2400	3.015	15512	1.33%
STANDARD CHARTERED PLC	1150	3.924	9850	1150	3.561	8779	0.76%
BNP PARIBAS	450	36.565	32182	450	30.975	27262	2.34%

<sup>1</sup> Цени в съответната валута

SHS SOCIETE GENERALE	600	13.582	15938	600	11.318	13282	1.14%
BANCO SANTANDER SA ORD	7095	1.863	25849	7095	1.600	22197	1.91%
BANCO BILBAO VISCAYA ARGENTARIA	5577	2.453	26757	5577	2.372	25873	2.23%
СОФИЯ КОМЕРС - ЗАЛОЖНИ КЪЩИ АД	1825	6.000	10950	1825	6.250	11406	0.98%
БЪЛГАРСКА ФОНДОВА БОРСА-СОФИЯ АД	6647	4.780	31773	6647	4.320	28715	2.47%
ЦКБ АД	30000	0.975	29250	30000	0.936	28080	2.41%
КВС	1000	48.100	94075	1000	42.790	83690	7.20%
ERSTE BANK AG	1446	20.380	57637	1446	17.875	50553	4.35%
RAIFFEISEN INTERNATIONAL BANK- HOLD. AG	1750	15.000	51341	1750	13.070	44735	3.85%
ISHARES JPM EMERG BOND	300	94.122	55226	300	93.692	54974	4.73%
NN GROUP права	1415	1.921	5316				
Total:			1011651.53			949664.44	81.67%

### Репо сделки

През периода не са сключвани договори за репо сделки, както и няма прекратени такива договори; не са закупвани, и не са продавани финансови инструменти по репо сделки; към края на периода няма действащи договори за репо сделки.

### 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:  
08.10.2020 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. Предшните резултати от дейността на фондовете нямат по необходимост връзка с бъдещите такива. Проспектът, документа с ключова информация за инвеститорите и правилата на организираниите 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.