

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 01.3.2014 Г. ДО 31.3.2014 Г.

Направени промени в структурата на портфейла и обособка за тях

Към края на месец март нетните активи на фонда са 1715222.36 лв., което представлява увеличение от 42739.33 лв. спрямо края на месец февруари. Броят на емитираните дялове намалява с - 7902.73 и достига 4365210.10.



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

Настроенията на пазарите към развиващите се пазари се промени през март. Развиващите се пазари бяха подложени на значителен натиск през последните месеци покрай проблемите в Украйна, натиска върху валутите на развиващите се пазари през последната половина година и страховете за забавяне на Китай. През март настроенията се обърнаха, на местните избори в Турция, Ердоган успя да вземе достатъчно мнозинство, за да успокои пазарите, че ще има стабилна подкрепа, Китай започна да дава сигнали, че е възможно да стимулира икономиката ако растежа падне допълнително, а в Украйна ситуацията намери някакъв баланс – макар и крехък. Очакванията за увеличаване на растежа през 2014 г. в развите икономики също подхранва оптимизъм.

Изменение	Q4 2012	Q1 2013	Q2 2013	Q3 2013	Q4 2013	Q1 2014	Март 2014
ДФ Скай Финанси	11.33%	-0.84%	-5.58%	6.63%	2.68%	3.31%	2.7%
CECE Banking Financial Index	13.8%	-5.6%	-1.6%	10.6%	4.04%	3.7%	-1.08%

Стандартно отклонение

	Стандартно отклонение
ДФ Скай Финанси	14.45%
CECE Banking Financial Index	21.37%

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

Активи	31.1.2014	28.2.2014	31.3.2014	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	1 260 811	1 317 267	1 433 795	83.36%
Облигации	-	-	-	-
Парични средства	190 042	359 506	280 615	16.32%
Депозити до 3 мес.	200 000	0	0	0.00%
Вземания	3 949	0	3 894	0.23%
Други	522	478	1 635	0.10%
Общо:	1 655 323	1 677 251	1 719 939	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “Скай Финанси” акции

Сотрану	28.2.2014			31.3.2014			
	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	5.8	10585.0	1825	5.8	10548.5	0.6%
Българска фондова борса-София АД	12647	3.9	48766.8	12647	3.9	49702.7	2.9%
CROATIA OSIGURANJE D.D.	19	7116.1	34570.3	19	7300.0	35472.3	2.1%
JADRANSKO OSIGURANJE D.D.	29	2950.0	21874.0	29	2900.0	21508.4	1.3%

¹ Цени в съответната валута

Privredna Banka Zagreb D.D.	155	460.0	18230.5	155	441.5	17501.5	1.0%
ZAGREBACHKA BANKA D.D.	4025	26.3	27066.4	4025	28.5	29286.0	1.7%
SIF MOLDOVA BACAU	80000	1.4	47963.8	80000	1.3	44386.9	2.6%
SIF OLTENIA CRAIOVA	45000	2.0	38162.5	45000	2.0	38803.5	2.3%
Agrobanka a.d. Beograd	121	0.0	0.0	121	0.0	0.0	0.0%
AIK banka a.d. Niš	1282	1479.0	31986.8	1282	1490.0	32378.6	1.9%
Dunav Osiguranje A.D.	258	700.0	3046.7	258	590.0	2580.2	0.2%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	950	1700.0	27245.0	950	1601.0	25780.9	1.5%
Metals Banka AD Novi Sad	105	0.0	0.0	105	0.0	0.0	0.0%
Akbank Turk AS	6000	5.7	21968.3	6000	6.8	26874.3	1.6%
T. Garanti Bankasi	20500	6.1	79519.8	20500	7.3	98842.1	5.7%
İŞ BANKASI (C)	8400	4.1	21991.3	8400	4.8	26281.5	1.5%
Haci Omer Sabanci Holding	7000	7.8	35083.9	7000	8.3	38269.5	2.2%
Turkiye Halk Bankasia A.S.	2100	10.9	14584.7	2100	13.3	18327.9	1.1%
YAPI VE KREDI BANK	10000	3.3	21187.3	10000	4.1	26742.6	1.6%
Erste Bank AG	1446	25.7	72711.2	1446	24.8	70137.6	4.1%
Raiffeisen International Bank-Hold. AG	750	25.3	37038.5	750	24.2	35498.3	2.1%
KBC	1750	46.0	157375.9	1750	44.7	152823.7	8.9%
Deutsche Bank AG	450	35.2	31015.6	450	32.5	28582.0	1.7%
NBG	120	3.6	835.5	120	3.9	924.7	0.1%
Piraeus Bank S.A.	347	2.0	1357.4	347	2.0	1357.4	0.1%

BANCO SANTANDER SA ORD	6154	6.6	79029.5	6154	6.9	83302.4	4.8%
BANCO BILBAO VISCAYA ARGENTARIA	7336	9.0	129060.0	7336	8.7	125085.6	7.3%
Intesa Sanpaolo	12000	2.2	52713.5	12000	2.5	57726.7	3.4%
SHS UNICREDIT SPA ORD REG	12700	5.8	143197.1	12700	6.6	164856.7	9.6%
HSBC HOLDINGS				2400	6.1	34431.3	2.0%
STANDARD CHARTERED				1150	12.5	34042.2	2.0%
BNP Paribas	450	59.5	52332.1	450	56.0	49278.1	2.9%
SHS SOCIETE GENERALE	600	48.4	56768.0	600	44.7	52461.2	3.1%
Total:			1317267.5			1433795.3	83.4%

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:
10.4.2014 г.

Съставил:
Иван Иванов: