

ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ ФИНАНСИ“

01.11.2020 г. - 30.11.2020 г.

Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на месец ноември нетните активи на фонда са 1 294 411.36 лв., което представлява увеличение от 170 920.78 лв. спрямо края на месец октомври. Броят на емитираните дялове остава без промяна на 3911827.1891.

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



Мерките и борбата с Ковид 19 продължи да определя движението на пазарите и през ноември. За разлика от предходните месеци обаче, новините бяха оптимистични. Три ваксини вече се оказаха достатъчно надежни и ефективни и това даде гориво на оптимизма на пазарите. Несигурността, кога подтиснатата икономическа активност ще спре да бъде фактор, започна силно да намалява, като вече проблемите са по-скоро от логистичен характер – как ваксините ще се доставят и използват – а не от фундаментален характер, ще се върнем ли изобщо някога към нормалността.

Позитивизмът се появи не само в пазарните индекси, но и в очакванията в самите икономики. Един от най-добрите изпреварващи индикатори PMI вече е на положителна територия за голяма част от света. САЩ, Китай, Индия и Бразилия продължават да подобряват очакванията си за икономиките. Европа все още е основно в червената територия, но Германия и вече Великобритания също отчитат експанзия, а негативните очаквания на Италия, Испания и Франция са доста по-слаби.

Пазарните движения на индексите отразяват до голяма степен този оптимизъм, като всички основни индекси завършиха месеца на положителна територия. Разбираемо растежът бе най-висок, там където негативните очаквания преди това бяха най-силни. В Европа и Латинска Америка.

През следващите месеци най-вероятно влиянието на пандемията върху пазарите ще продължи да отслабва, като фокуса ще премине към традиционните фактори. Икономически растеж, парична и фискална политика. След почти година доминация на външен фактор върху пазарите, е възможно връщането към обикновения начин за оценки да донесе известни изненади на пазарите. Но все още е твърде рано да се изградят обосновани очаквания за това.

Представяне на фонда по периоди

Изменение	Q2 2019	Q3 2019	Q4 2019	Q1 2020	Q2 2020	Q3 2020	Октомври 2020	Ноември 2020
ДФ Скай Финанси	0.55%	1.56%	5.50%	-27.91%	6.73%	-6.7%	-2.94%	15.22%
CECE Banking Financial Index	-0.2%	-5.8%	7.8%	-43.6%	11.7%	-11.2%	-7.59%	33.10%

Стандартно отклонение

	Стандартно отклонение
ДФ Скай Финанси	28.13%
CECE Banking Financial Index	45.72%

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	30.9.2020	31.10.2020	30.11.2020	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	949 664	919 211	1 093 773	84.16%
Облигации	0	0	0	-
Парични средства	212 518	208 975	205 624	15.82%
Депозити до 3 мес.	0	0	0	0.00%
Вземания	0	0	0	0.00%
Други	565	374	190	0.01%
Общо:	1 162 747	1 128 560	1 299 587	100.00%

Информация за паричните средства

Към 30.11.2020 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	31.10.2020			30.11.2020			
	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	19431	2.150	8343	19431	2.860	11668	0.90%
HACI OMER SABANCI HOLDING	7000	8.230	11505	7000	9.640	14168	1.09%
T. GARANTI BANKASI	10500	6.600	13839	10500	8.750	19290	1.48%
ZAVAROVALNICA TRIGLAV	1500	27.100	79504	1500	29.300	85959	6.61%
METALS BANKA AD NOVI SAD	105	0.005	0	105	0.005	0	0.00%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	950	2900.000	45831	950	3000.000	47406	3.65%
DUNAV OSIGURIANJE A.D.	258	3450.000	14807	258	3450.000	14806	1.14%
AGROBANKA A.D. BEOGRAD	121	0.005	0	121	0.005	0	0.00%
SIF OLTENIA CRAIOVA	45000	1.720	31069	45000	1.690	30522	2.35%
SIF MOLDOVA BACAU	101845	1.200	49057	101845	1.200	49050	3.77%
SIF BANAT CRISANA SA /SIF 1/	60500	1.880	45655	60500	1.900	46134	3.55%
NN GROUP	1518	29.940	88890	1518	34.050	101093	7.78%
SHS UNICREDIT SPA ORD REG	2377	6.338	29464	2377	8.714	40512	3.12%
INTESA SANPAOLO	12000	1.404	32952	12000	1.932	45353	3.49%
JADRANSKO OSIGURANJE D.D.	29	3560.000	26657	29	3800.000	28533	2.20%
CROATIA OSIGURANJE D.D.	19	6100.000	29926	19	6550.000	32223	2.48%
HSBC HOLDINGS PLC	2400	3.246	16888	2400	3.883	20284	1.56%
STANDARD CHARTERED PLC	1150	3.518	8772	1150	4.522	11320	0.87%
BNP PARIBAS	450	29.855	26276	450	42.965	37815	2.91%

¹ Цени в съответната валута

SHS SOCIETE GENERALE	600	11.640	13660	600	16.686	19581	1.51%
BANCO SANTANDER SA ORD	7095	1.711	23740	7095	2.418	33547	2.58%
BANCO BILBAO VISCAYA ARGENTARIA	5577	2.462	26855	5577	3.930	42867	3.30%
СОФИЯ КОМЕРС - ЗАЛОЖНИ КЪЩИ АД	1825	6.300	11498	1825	6.575	11999	0.92%
БЪЛГАРСКА ФОНДОВА БОРСА-СОФИЯ АД	6647	4.200	27917	6647	4.279	28440	2.19%
ЦКБ АД	30000	0.880	26400	30000	0.892	26760	2.06%
КВС	1000	42.330	82790	1000	58.400	114220	8.79%
ERSTE BANK AG	1446	17.580	49719	1446	24.100	68158	5.24%
RAIFFEISEN INTERNATIONAL BANK-HOLD. AG	1750	12.340	42236	1750	16.060	54969	4.23%
ISHARES JPM EMERG BOND	300	93.672	54962	300	94.834	55644	4.28%
BANCO SANTANDER SA rights				7095	0.105	1453	0.11%
Total:			919211.44			1093772.58	84.16%

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:
08.12.2020 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. Предишните резултати от дейността на фондовете нямат по необходимост връзка с бъдещите такива. Проспектът, документа с ключова информация за инвеститорите и правилата на организирания 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.