

ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ ГЛОБАЛ ETFs ”

01.8.2016 г. - 31.8.2016 г.

Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на месец август нетните активи на фонда са 5 474 564.97 лв., което представлява намаление от -8 558.05 лв. спрямо края на месец юли. Броят на емитираните дялове остава без промяна на 26515.3816.

Представяне на индексите на развиващите се пазари

MSCI Index	MTD	3MTD	YTD	1 Yr	3 Yr	5 Yr	10 Yr
Китай	7.8%	10.3%	1.2%	6.0%	7.9%	6.2%	6.6%
Индия	1.4%	7.6%	4.2%	6.7%	19.7%	7.9%	6.1%
Индонезия	1.9%	17.1%	19.3%	28.8%	9.1%	2.5%	9.9%
Корея	3.6%	13.8%	10.5%	21.0%	6.2%	6.1%	4.0%
Малайзия	2.3%	5.0%	3.4%	10.1%	-3.1%	1.1%	5.6%
Филипини	-1.6%	4.6%	9.5%	10.1%	14.4%	17.1%	13.3%
Тайван	1.6%	10.3%	11.7%	13.1%	10.0%	7.9%	4.0%
Тайланд	3.4%	12.5%	27.1%	15.9%	8.5%	7.2%	9.1%
Бразилия	1.0%	31.7%	55.4%	34.8%	-2.5%	-7.9%	0.4%
Чили	-3.8%	4.9%	8.8%	4.7%	-3.5%	-6.6%	3.1%
Колумбия	10.0%	12.2%	25.2%	12.4%	-15.4%	-7.9%	3.3%
Мексико	1.6%	1.8%	-1.6%	-3.9%	-0.2%	2.5%	3.2%
Перу	-4.0%	12.0%	46.2%	35.2%	11.0%	1.0%	9.2%
Латинска Америка	0.8%	17.8%	28.0%	17.4%	-2.3%	-5.2%	1.2%
Чехия	-9.9%	-8.7%	-11.0%	-24.4%	-6.0%	-10.5%	-5.2%
Унгария	3.2%	7.3%	18.4%	33.9%	9.7%	2.3%	-2.2%
Полша	2.2%	0.6%	-5.5%	-19.9%	-9.2%	-6.2%	-5.2%
Русия	2.9%	3.8%	18.9%	11.4%	-6.4%	-6.4%	-6.8%
Турция	1.8%	-2.9%	2.1%	-0.2%	-2.4%	1.1%	0.4%
Египет	2.2%	15.9%	12.2%	9.2%	18.2%	11.4%	1.6%
Южна Африка	-7.4%	7.9%	11.7%	-4.7%	3.2%	0.7%	3.4%
Развиваща се Азия	4.3%	10.7%	6.9%	11.7%	8.5%	6.3%	5.0%
Развиващи се пазари	2.7%	10.6%	9.8%	9.8%	4.4%	2.3%	2.9%

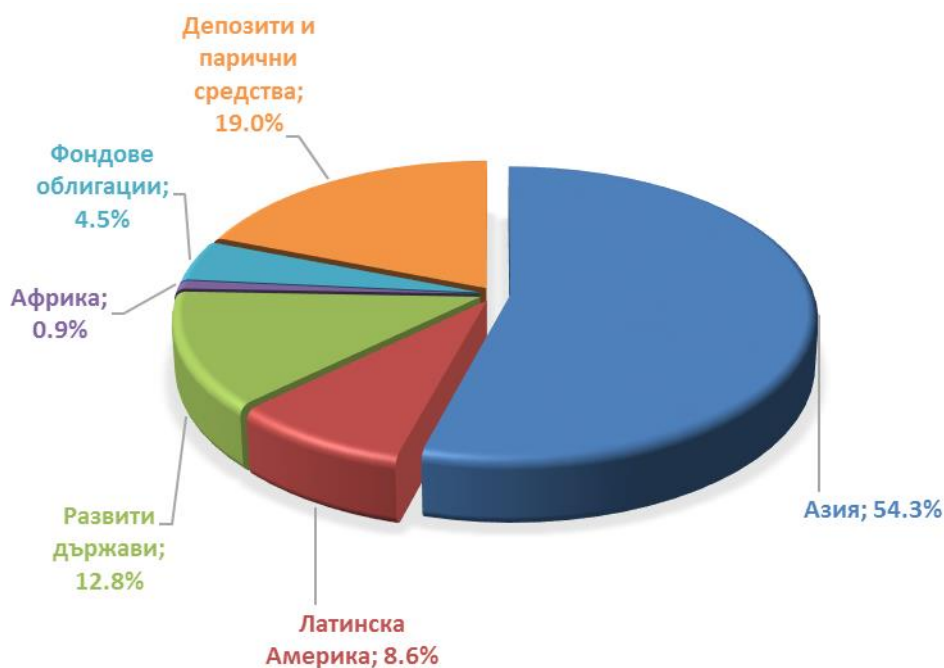
Към 31.8.2016 г.

Лежерното лятно настроение обхваща и пазарите. Волатилността значително намаля, също както и обемите на търговия. Преобладаващият последните месеци положителен тренд се задържа на повечето пазари, като често валутните курсове влияеха в по-голяма степен на представянето на фондовете отколкото традиционно по-нестабилните фондови пазари.

До известна степен тази апатия се дължи на сезона, но влияние оказва и липсата на неочаквани новини, както от страна на отделни компании, така и що се отнася до макроикономически данни. През последните година, година и половина, основно централните банки създаваха новини, движещи пазарите, но за тях ще трябва да почакаме до септември.

Все пак подобно ниско ниво на волатилност е до известна степен притеснително. Чисто технически това предполага, че в цените на акциите не са включени изненади. Че липсват сериозни различия в мненията за това какво ще се случва са пазара. А подобна хомогенност на очакванията, често води до сериозни негативни движения впоследствие.

Разпределение на активите на фонда по региони

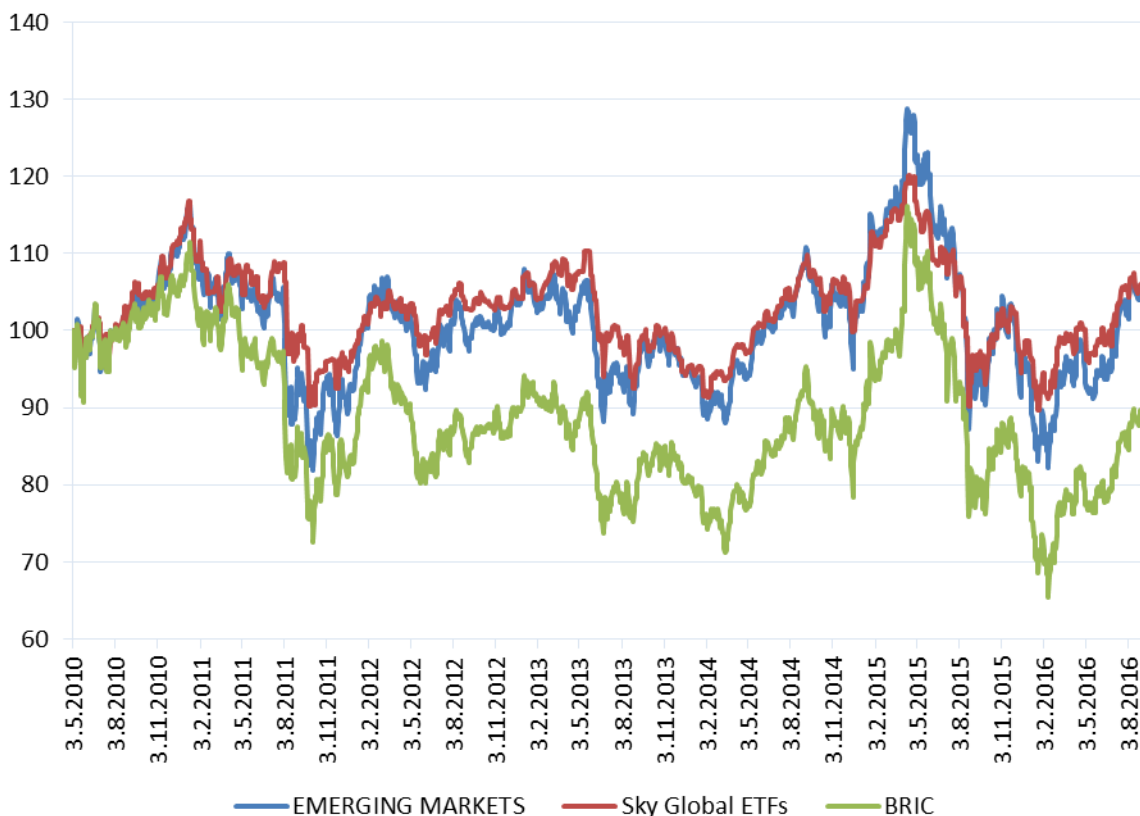


Стойност на портфейла в началото и в края на отчетния период в лева

Активи	30.06.2016	31.07.2016	31.08.2016	Структура на активите спрямо общата им стойност %/
Дялове в КИС, акции и права	4 216 330	4 407 405	4 439 737	80.96%
Облигации	0	0	0	0.0%
Парични средства	1 052 307	1 051 372	1 043 909	19.03%
Депозити до 3 мес.	0	0	0	0.00%
Вземания	0	1 052	0	0.0%
Други	1 031	857	684	0.01%
Общо:	5 269 668	5 460 685	5 484 330	100.0%

Информация за паричните средства

Към 31.8.2016 г. Фонда няма депозити. Паричните средства са по сметки на Фонда в банката-депозитар Юробанк България АД.

Движение на ДФ Скай Глобал ETFs спрямо MSCI EM и BRIC

Доходност на ДФ Скай Глобал ETFs спрямо MSCI EM

	Q1 2015	Q2 2015	Q3 2015	Q4 2015	Q1 2016	Q2 2016	Юли 2016	Август 2016
Доходност MSCI EM	14.8%	-3.8%	-18.7%	3.03%	0.45%	2.24%	4.03%	2.73%
Доходност ДФ Скай Глобал ETFs	10.23%	-5.4%	-13.6%	4.44%	0.92%	1.88%	4.2%	-0.16%
Стандартно отклонение на ДФ Скай Глобал ETFs								15.34%

Стойност на притежаваните от ДФ “Скай Глобал ETFs” финансови инструменти

Company	31.7.2016				31.8.2016			
	Брой ценни книжа	Цена за брой ¹	Балансова стойност в лв	Процент от активите	Брой ценни книжа	Цена за брой ¹	Балансова стойност в лв	Процент от активите
LYXOR INTL PAN AFRICA UCITS C EUR	3000	8.938	52443.63	0.96%	3000	8.46	49638.97	0.91%
DB X-TRACKERS MSCI SINGAPORE	53000	1.03	106768.76	1.96%	53000	1.013	105006.56	1.91%
DB X-TRACKERS MSCI PHILIPPINES IM TRN INDEX UCITS ETF	25600	1.949	97584.96	1.79%	25600	1.903	95281.78	1.74%
MULTI UNITS LUXEMBOURG-LYXOR ETF AUSTRALIA (S&P ASX)	2500	39.61	193676.07	3.55%	2500	38.29	187221.83	3.41%
DB X-TRACKERS MSCI INDONESIA TRN INDEX ETF	5499	12.83	137988.05	2.53%	5499	12.8	137665.4	2.51%
DB X-TRACKERS MSCI MEXICO	21565	4.107	173222.89	3.17%	21565	4.191	176765.79	3.22%
DB X-TRACKERS FTSE VIETNAM ETF	845	21.94	36259.72	0.66%	845	22	36358.88	0.66%
DB X-TRACKERS MSCI AC ASIA X-JP	1100	30.57	65768.7	1.20%	1100	31.27	67274.68	1.23%
AMUNDI FUNDS ASEAN NEW MARKETS-C (USD)	1720.45	90.3	273419.91	5.01%	1720.45	90.19	272619.79	4.97%
DB X-TRACKER NIFTY 50 UCITS ETF	1000	118.35	231472.48	4.24%	1000	119.53	233780.36	4.26%
DB X-TRACKERS MSCI TAIWAN	3833	19.76	148134.72	2.71%	3833	19.903	149206.75	2.72%
DB X-TRACKERS MSCI EM ASIA	1020	34.57	68965.3	1.26%	1020	35.54	70900.4	1.29%
DB X-TRACKERS MSCI KOREA TRN	1301	51.13	130102.07	2.38%	1301	52.12	132621.16	2.42%
AMUNDI FUNDS THAILAND (USD)	1437.028	132.34	334700.75	6.13%	1437.028	134.79	340314.01	6.21%
FIDELITY FUNDS-INDONESIA FUND A (USD)	1500	27.24	71911.56	1.32%	1500	27.43	72289.3	1.32%

¹ Цена в оригинална валута

ISHARES MSCI BRAZIL	1100	52.91	113831.26	2.08%	1100	53.35	114777.88	2.09%
ISHARES MSCI CANADA B	1307	97.96	250412.19	4.59%	1307	98.52	251843.7	4.59%
ISHARES MSCI AC FAR EAST EX-JAPAN SMALL CAP	1100	23.78	51160.6	0.94%	1100	24.01	51655.43	0.94%
ISHARES JPM EMERG BOND	1200	102.59	240778.32	4.41%	1200	104.36	244932.5	4.47%
ISHARES MSCI EM LATIN AMERICA UCITS ETF	3400	13.89	92366.03	1.69%	3400	14.048	93416.7	1.70%
ISHARES MSCI AC FAR EAST XJP	1720	39.05	131365.28	2.41%	1720	40.12	134964.79	2.46%
ISHARES MSCI TAIWAN	3823	33.29	248913.93	4.56%	3823	33.47	250259.81	4.56%
ISHARES MSCI KOREA	3562	32.37	225510.99	4.13%	3562	33.01	229969.66	4.19%
LYXOR ETF MSCI TAIWAN	5800	10.5	119110.05	2.18%	5800	10.56	119790.68	2.18%
LYXOR BRAZIL (IBOVESPA) UCITS ETF	3000	14.22	83435.71	1.53%	3000	14.47	84902.58	1.55%
LYXOR ETF MSCI MALAYSIA	7994	14.04	219514.07	4.02%	7994	14.12	220764.86	4.03%
LYXOR ETF KOREA	608	45.21	53761.23	0.98%	608	46.05	54760.11	1.00%
LYXOR ETF MSCI INDIA	2480	14.42	69943.61	1.28%	2480	14.44	70040.62	1.28%
LYXOR ETF MSCI AC ASIA PACIFIC EX JAPAN	1524	43.08	128407.91	2.35%	1524	43.7	130255.93	2.38%
ISHARES STOXX EUROPE 600 AUTOMOBILES & PARTS UCITS ETF	1300	46.16	117365.45	2.15%	1300	46.58	118433.33	2.16%
ISHARES NIKKEI 225	5000	14.225	139108.41	2.55%	5000	14.523	142022.6	2.59%
			4 407 404.61	80.71%			4 439 736.84	80.95%

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:

9.9.2016 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.