

ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ НОВИ АКЦИИ”

01.9.2016 г. - 30.9.2016 г.

Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на месец септември нетните активи на фонда са 7 893 628.89 лв., което представлява увеличение от 33 632.64 лв. спрямо края на месец август. Броят на емитираните дялове се увеличава с 286.8958 и достига 11 287 885.2081.

Изменение на индексите в местна валута и разпределение на портфейла по държави

Изменение	Q3 2015	Q4 2015	Q1 2016	Q2 2016	Q3 2016	Септември 2016
SOFIX	4.03%	-3.2%	-0.24%	2.06%	10.8%	8.59%
CROBEX	0.24%	-1.2%	3.43%	0.38%	15.8%	6.8%
BELEX 15	2.51%	-5.9%	3.13%	-0.23%	5.2%	1.53%
BET-XT	0.17%	-4.5%	4.81%	-4.07%	7.1%	-1.1%
ISE 100	-5.51%	16.1%	9.83%	-7.75%	-0.4%	0.69%
DFNEW	-1.04%	2.04%	5.20%	-3.82%	5.17%	0.43%
Средно аритметично за индексите	0.29%	0.3%	4.19%	-1.92%	7.7%	3.28%
Дял на съответната държава от активите на фонда	30.09.2015	31.12.2015	31.03.2016	30.06.2016	30.09.2016	
България	13.83%	14.07%	13.41%	14.12%	16.44%	
Хърватска	4.53%	4.70%	4.73%	4.91%	5.15%	
Сърбия	3.61%	4.11%	4.18%	4.09%	2.92%	
Румъния	28.83%	28.70%	26.64%	26.19%	27.15%	
Турция	27.15%	26.67%	30.64%	28.97%	26.70%	
Словения	10.68%	11.71%	11.42%	10.73%	10.87%	
Други	3.30%	3.43%	3.37%	3.71%	3.57%	

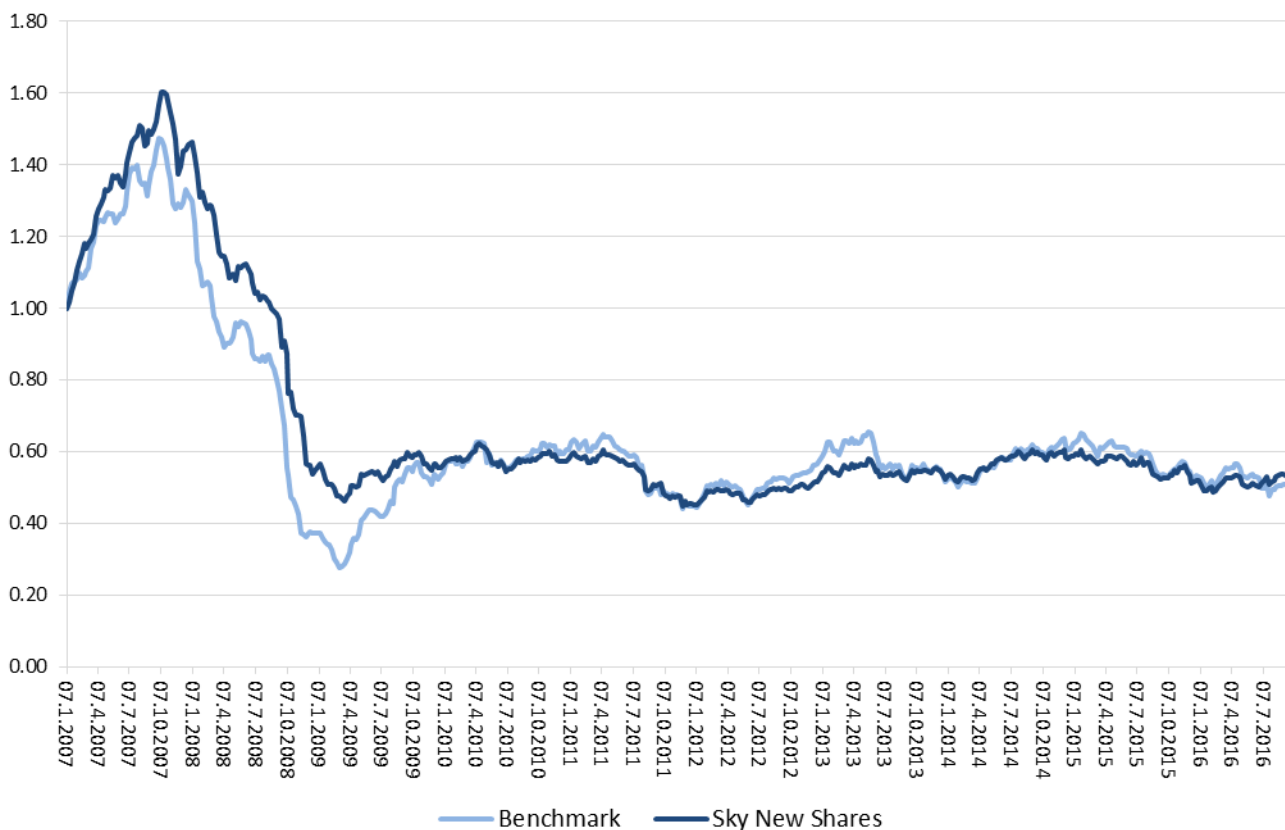
Информация за паричните средства

Към 30.9.2016 г. Фонда няма депозити. Паричните средства са по сметки на Фонда в банката-депозитар Юробанк България АД.

Информация за риск-доходност на ДФ „СКАЙ Нови Акции”

Индекс	Стандартно отклонение	Изменение 12 месеца	Изменение 24 месеца
SOFIX	8.30%	13.89%	-6.44%
CROBEX	8.97%	15.17%	1.21%
BELEX 15	13.40%	1.27%	-3.79%
BET-XT	13.36%	-1.81%	-3.35%
ISE 100	25.60%	0.77%	2.07%
Служебен бенчмарк	14.92%	5.86%	-2.06%
DFNEW	12.80%	2.15%	-9.23%

Стандартното отклонение е измерено на седмична база за последните 52 седмици. Промяната на индексите е в местна валута.

Движение на цената на фонда спрямо служебния бенчмарк в лева


Търговията в изключително тесен диапазон продължи и през септември. Появилите се за кратко съмнения, че ФЕД може да се окаже по-агресивен във вдигането на лихвите от очакваното, предизвика кратък пик на волатилността в началото на месеца, но в последствие пазарите се успокоиха и липсата на енергия да тръгнат на където и да било се почувства отново.

Поради липсата на новини, които да създадат тренд при акциите, валутните курсове придобиха доста по-голямо от обичайното влияние. Представянето на даден пазар често бе определено от това как се движи местната му валута. Нещо до известна степен рядко срещано, тъй като обикновено валутните курсове имат доста по-слаба волатилност от пазарите на акции.

Доста слабо вероятно е тази липса на посока и слаби колебания да се запазят и през следващите месеци. През октомври започват да излизат отчетите на компаниите за третото тримесечие. Колкото и ФЕД да отлагат вдигането на лихвите, то е сигурно, че и този момент приближава. Ако не променят параметрите на количествените улеснения в Европа, те ще започнат да дават все по-малко резултат. А от тук и по-слабо да въздействат за снижаване на волатилността.

Представяне на фонда за последната година - по месеци

Доходност по месеци	Средно аритметично за индексите	DFNEW
Септември 2015	-1.55%	-1.93%
Октомври 2015	1.76%	3.30%
Ноември 2015	-2.34%	-0.28%
Декември 2015	0.97%	-3.93%
Януари 2016	-4.39%	-3.93%
Февруари 2016	0.50%	0.95%
Март 2016	4.19%	5.20%
Април 2016	-0.04%	-0.22%
Май 2016	-2.10%	-4.10%
Юни 2016	0.28%	0.51%
Юли 2016	2.67%	1.46%
Август 2016	1.55%	3.22%
Септември 2016	3.28%	0.43%

Обем и структура на инвестициите в портфейла
Стойност на портфейла в началото и в края на отчетния период в лева

Активи	30.6.2016	31.7.2016	31.8.2016	30.9.2016	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права и КИС	6 982 227	6 993 571	7 256 935	7 344 025	92.79%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	517 330	597 927	616 293	548 854	6.93%
Депозити до 3 мес.	0	0	0	0	0.00%
Вземания	29 319	43 683	7 516	21 310	0.27%
Разходи за бъдещи периоди	1 031	857	684	516	0.01%
Общо:	7 529 908	7 636 039	7 881 426	7 914 705	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “СКАЙ Нови Акции” акции

Дружество	31.8.2016			30.9.2016			
	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
АКЦИИ БЪЛГАРИЯ							
Софарма АД - София	81992	2.64	216049	85035	2.95	250598	3.17%
М и С ХИДРАВЛИК АД	11490	4.99	57301	11490	5.35	61494	0.78%
ЗЪРНЕНИ ХРАНИ БЪЛГАРИЯ АД	9766	0.30	2930	9766	0.32	3106	0.04%
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	282929	0.67	188148	282929	0.67	188431	2.38%
Монбат АД	20000	7.06	141140	20000	7.68	153640	1.94%
София Комерс - заложни къщи АД	4812	3.79	18237	4812	3.65	17564	0.22%
Албена инвест холдинг	7017	9.06	63602	7017	9.16	64283	0.81%
Химимпорт АД	42568	1.21	51465	62578	1.36	84918	1.07%
СИРМА ГРУП ХОЛДИНГ АД	33333	1.06	35366	33333	1.06	35166	0.44%

¹ Цени в съответната валута

ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.00	149	149450	0.00	149	0.00%
ЧЕЗ РАЗПРЕДЕЛЕНИЕ БЪЛГАРИЯ АД	600	119.50	71700	600	125.62	75374	0.95%
Индустриален Холдинг България АД	23333	0.78	18200	48333	0.93	45046	0.57%
ИД Елана високодоходен фонд	3316	91.84	304544	3316	97.01	321690	4.06%
Общо:			1168831			1301460	16.44%
АКЦИИ ХЪРВАТСКА							
KONCHAR ELECTROINDUSTRIJA D.D.	844	675.00	148992	844	677.00	148569	1.88%
KONCHAR TRANSFORMATORI	412	1280.01	137920	412	1380.00	147834	1.87%
Duro Dakovic holding	1000	51.00	13338	1000	50.76	13198	0.17%
Atlanska Plovitba D.D. DUBROVNIK	730	175.00	33410	730	180.02	34170	0.43%
Adris P-A	560	406.00	59461	560	437.50	63704	0.80%
Общо:			393121			407475	5.15%
АКЦИИ РУМЪНИЯ							
CNTEE TRANSELECTRICA SA	29275	29.95	384710	29275	29.30	376682	4.76%
TRANSGAZ SA MEDIAS	900	303.00	119653	900	306.00	120941	1.53%
Petrom Bucuresti	3000000	0.26	336978	3000000	0.24	321456	4.06%
S.N.G.N. ROMGAZ S.A.	5000	23.85	52324	5000	23.25	51051	0.65%
SIF OLTENIA CRAIOVA	335000	1.67	245766	335000	1.55	228027	2.88%
SIF Transilvania /SIF 3/	400000	0.28	48353	400000	0.28	49097	0.62%
SIF MOLDOVA BACAU	468000	0.77	158732	468000	0.76	155785	1.97%
SIF Banat Crisana /SIF 1/	250000	1.67	183627	250000	1.66	182246	2.30%
SNO - Santierul Naval Orsova	17700	2.59	20115	17700	2.46	19121	0.24%

Farmaceutica Remedia SA	104000	0.20	8944	104000	0.20	9226	0.12%
SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/	1466649	0.79	510960	1466649	0.80	517192	6.53%
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	24420	11.40	122149	24420	11.00	117964	1.49%
ОБЩО			2192309			2148786	27.15%
АКЦИИ СЪРБИЯ							
Veterinarski zavod AD	3017	335.00	16052	3017	295.00	14119	0.18%
Novosadski sajam a.d. Novi Sad	1745	1050.10	29102	1745	1050.10	29068	0.37%
NIS AD NOVI SAD	3881	573.00	35318	3881	590.00	36324	0.46%
RTC LUKA LEGET A.D.	223	3170.75	11230	223	3170.75	11217	0.14%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	210	1498.00	4996	210	1548.00	5157	0.07%
ALFA PLAM a.d. Vranje	266	31000.00	130961	266	32000.00	135028	1.71%
Agrobanka a.d. Beograd	132	0.01	0	132	0.01	0	0.00%
Общо			227658			230912	2.92%
АКЦИИ ТУРЦИЯ							
TURK TRAKTOR	6500	86.35	333351	6500	81.45	308394	3.90%
TAV HAVALIMANLARI	33000	11.54	226176	33000	12.37	237786	3.00%
MIGROS	6000	17.60	62718	6000	18.28	63889	0.81%
Enka Insaat Ve Sanayi AS	26130	4.37	67818	26130	4.39	66820	0.84%
YAPI VE KREDI BANKASI	63000	3.64	136197	63000	3.67	134682	1.70%
Turkcell	15000	9.93	88464	15000	9.71	84842	1.07%
Haci Omer Sabanci Holding	16888	9.13	91575	16888	9.29	91389	1.15%
KOC HOLDING	34755	12.84	265038	34755	12.89	260959	3.30%
İŞ BANKASI (C)	33800	4.81	96558	33800	4.75	93522	1.18%
T. GARANTI BANKASI	42500	7.63	192593	42500	7.95	196815	2.49%

EREĞLİ DEMİR CELİK /EREGL	62000	4.45	163862	62000	4.13	149157	1.88%
Arcelik /ARCLK.E	21000	21.16	263913	21000	21.12	258354	3.26%
ADANA CIMENTO C	219360	0.69	89894	219360	0.72	92001	1.16%
ADANA CIMENTO A	21000	6.15	76705	21000	6.07	74252	0.94%
Общо			2154863			2112862	26.70%
АКЦИИ СЛОВЕНИЯ							
KRKA DD	5475	58.00	621074	5475	61.90	662836	8.37%
ZAVAROVALNICA TRIGLAV	4483	24.33	213325	4483	22.50	197280	2.49%
Общо			834399			860115	10.87%
ISHARES JPM EMERG BOND	1400	104.36	285755	1400	103.14	282414	3.57%
Общо:			7256935			7344025	92.79%

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:

10.10.2016 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 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.