

ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ ГЛОБАЛ ЕТФС “

01.2.2018 г. - 28.2.2018 г.

Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на месец февруари нетните активи на фонда са 5 835 682.95лв., което представлява намаление от -115 334.26 лв. спрямо края на месец януари. Броят на емитираните дялове остава без промяна на 26060.3816.

Представяне на индексите на развиващите се пазари в евро

MSCI Index	MTD	3MTD	YTD	1 Yr	3 Yr	5 Yr	10 Yr
Китай	-4.4%	4.9%	3.7%	25.4%	7.1%	9.7%	4.6%
Индия	-4.9%	-1.3%	-5.2%	4.0%	-0.3%	8.6%	2.7%
Индонезия	-1.0%	6.0%	-1.7%	3.6%	0.2%	-0.4%	4.7%
Корея	-4.6%	-3.6%	-4.7%	10.6%	7.5%	6.0%	5.4%
Малайзия	0.6%	9.7%	4.5%	7.0%	-5.2%	-1.4%	2.4%
Филипини	-2.7%	-3.6%	-7.5%	-3.4%	-5.9%	1.3%	8.3%
Тайван	-1.0%	3.2%	2.7%	2.5%	3.7%	9.1%	5.0%
Тайланд	4.2%	13.5%	9.0%	21.2%	5.5%	4.4%	8.8%
Бразилия	-0.7%	15.3%	11.8%	4.0%	6.5%	-2.1%	-3.2%
Чили	-1.7%	16.5%	1.5%	16.8%	6.2%	-2.6%	3.6%
Колумбия	-5.2%	8.4%	1.7%	1.9%	-5.0%	-11.6%	3.5%
Мексико	-5.3%	-2.4%	-1.6%	-6.3%	-8.1%	-4.7%	1.1%
Перу	-0.8%	5.2%	4.8%	15.9%	11.5%	5.2%	4.8%
Латинска Америка	-2.0%	10.3%	6.8%	2.8%	2.1%	-3.0%	-1.6%
Чехия	-2.5%	4.4%	1.8%	11.1%	-4.4%	-2.6%	-6.9%
Унгария	-5.7%	1.9%	-2.0%	16.9%	27.6%	9.6%	-0.2%
Полша	-8.0%	-0.8%	-3.5%	11.9%	-0.1%	-0.1%	-3.1%
Русия	3.1%	13.4%	11.8%	6.2%	8.5%	-1.9%	-4.7%
Турция	0.0%	13.5%	1.2%	10.1%	-5.8%	-5.9%	-0.6%
Египет	1.7%	-2.8%	-3.1%	-17.8%	-15.0%	0.3%	-6.3%
Южна Африка	1.9%	8.9%	0.9%	13.6%	0.0%	4.4%	5.2%
Развиваща се Азия	-3.4%	2.4%	0.6%	13.7%	4.8%	7.3%	4.7%
Развиващи се пазари	-2.7%	4.3%	1.6%	11.2%	3.5%	4.0%	2.5%

Към 28.2.2018 г.

Последната година се случи нещо до известна степен нормално за дълъг период без никакви сътресения - волатилността на пазарите започна да пада. Рядко се случваше на развит пазар да има корекция дори от 5%. За това съдействаше и потокът от новини, който почти винаги бе позитивен и изключително рядко се появяваше нещо неочаквано и негативно. От една страна това поддържаше плавен ръст на индексите, от друга страна създаде до известна степен необоснована увереност в пазарните участници, особено в непрофесионалните такива. За това и неочакваното повишение на инфлацията в САЩ изведнъж предизвика сериозни сътресения през февруари. Волатилността рязко скочи, и както често се случва, самите колебания породиха други колебания и се заформира доста рязка корекция в началото на месеца. В последствие стана ясно, че няколко фонда залагащи на ниска волатилност са успели да загубят значителна част от стойността си и са допринесли за рязкостта на движението.

След доста турбулентното начало на февруари, волатилността на пазарите постепенно намаля. Реално все още се намират във фаза на консолидация, но инерцията надолу бе спряна в рамките на нормалното за последните две години. От САЩ катализаторите за движение на индексите се преместиха в други пазари, по-лошите от очакваните данни за Китай натежаха на азиатските индекси, които в по-голямата си част, завършиха месеца на минус. Все пак основната икономика, която определя настроеността към фондовите пазари, си остава САЩ. Докато там не се прекъсне възходящият тренд може да се очаква, че оптимизмът ще преобладава и в останалите части на света.



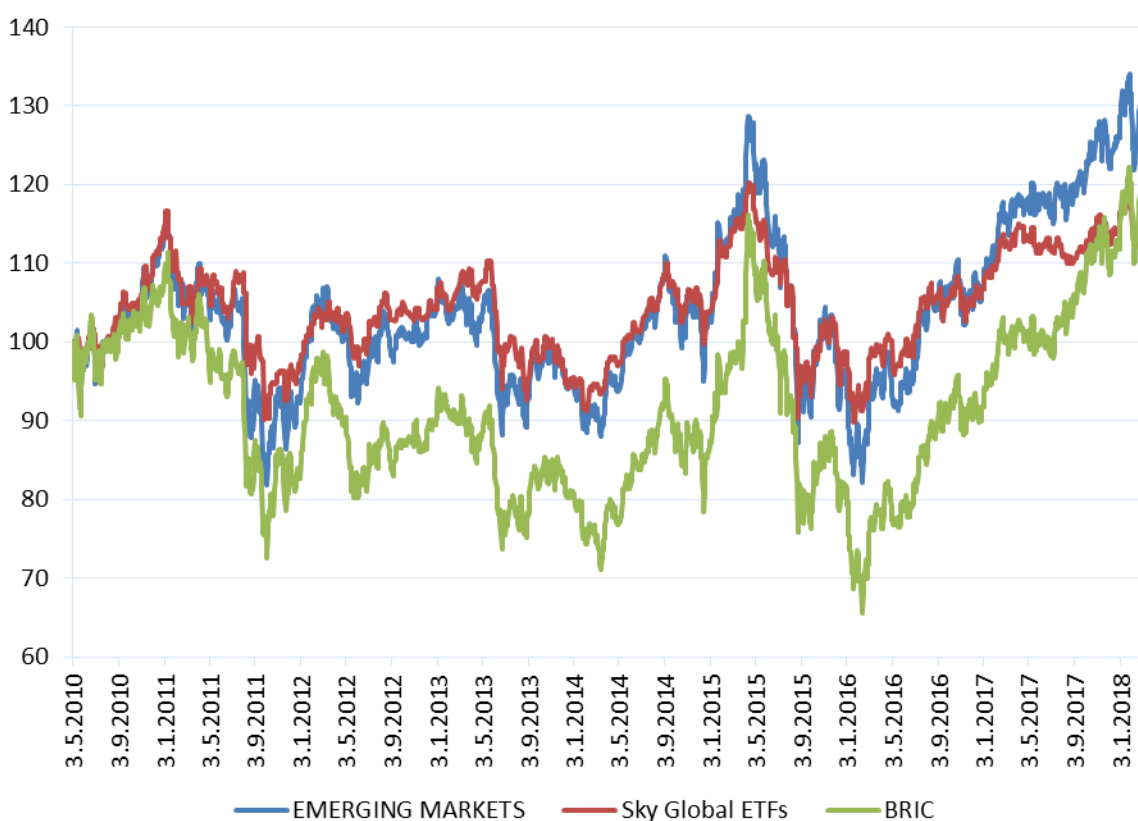
Стойност на портфейла в началото и в края на отчетния период в лева

Активи	31.12.2017	31.1.2018	28.2.2018	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Дялове в КИС, акции и права	5 214 388	5 324 638	5 214 842	89.19%
Облигации	0	0	0	0.0%
Парични средства	645 662	635 700	629 381	10.76%
Депозити до 3 мес.	0	0	0	0.00%
Вземания	1 087	839	575	0.01%
Други	0	2 013	1 845	0.03%
Общо:	5 861 137	5 963 191	5 846 642	100.0%

Информация за паричните средства

Към 28.2.2018 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

	Q2 2016	Q3 2016	Q1 2017	Q2 2017	Q3 2017	Q4 2017	Януари 2017	Февруари 2017
Доходност MSCI EM	2.24%	7.08%	9.6%	-1.1%	3.25%	5.43%	4.39%	-2.70%
Доходност ДФ Скай Глобал ETFs	1.88%	4.05%	7.04%	-2.1%	0.31%	2.61%	2.15%	-1.94%
Стандартно отклонение на ДФ Скай Глобал ETFs	8.66%							

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

Company	31.1.2018				28.2.2018			
	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	9.641	56568.47	0.95%	3000	9.639	56556.74	0.97%
DB X-TRACKERS MSCI SINGAPORE	53000	1.2494	129511.54	2.17%	53000	1.248	129366.42	2.21%
DB X-TRACKERS MSCI PHILIPPINES IM TRN INDEX UCITS ETF	25600	1.6786	84046.24	1.41%	25600	1.637	81963.36	1.40%
MULTI UNITS LUXEMBOURG-LYXOR ETF AUSTRALIA (S&P ASX)	2500	40.75	199250.18	3.34%	2500	40.18	196463.12	3.36%
DB X-TRACKERS MSCI INDONESIA TRN INDEX ETF	5499	13.814	148571.09	2.49%	5499	13.548	145710.22	2.49%
DB X-TRACKERS MSCI MEXICO	21565	4.1385	174551.47	2.93%	21565	3.9385	166115.98	2.84%
UBS ETF - MSCI PACIFIC (EX JAPAN) UCITS ETF (USD) A-DIS	2200	37.355	160732.07	2.70%	2200	36.815	158408.54	2.71%
DB X-TRACKERS FTSE VIETNAM ETF	845	30.195	49902.57	0.84%	845	30.425	50282.69	0.86%
AMUNDI FUNDS ASEAN NEW MARKETS-C (USD)	1720.45	105.84	285897.86	4.79%	1720.45	105.06	289435.74	4.95%
DB X-TRACKERS MSCI TAIWAN	3833	24.44	183219.26	3.07%	3833	23.8	178421.37	3.05%
DB X-TRACKERS MSCI KOREA TRN	1301	67.92	172824.81	2.90%	1301	64.5	164122.5	2.81%
AMUNDI FUNDS THAILAND (USD)	1437.028	183.44	413883.67	6.94%	1437.028	185.2	426166.12	7.29%
FIDELITY FUNDS-INDONESIA FUND A (USD)	1500	30.95	72890.5	1.22%	1500	29.8	71578.11	1.22%
ISHARES MSCI MEXICO CAPPED UCITS ETF USD	550	100.84	108474.24	1.82%	550	96	103267.82	1.77%
ISHARES MSCI BRAZIL	1100	70.5	151674.62	2.54%	1100	70.72	152147.93	2.60%

¹ Цена в оригинална валута

iSHARES MSCI CANADA B	1307	107.12	273827.62	4.59%	1307	102.7	262528.91	4.49%
ISHARES MSCI AC FAR EAST EX-JAPAN SMALL CAP	1100	27.32	58776.6	0.99%	1100	26.5	57012.44	0.98%
ISHARES MSCI EM LATIN AMERICA UCITS ETF	6800	16.832	223859.61	3.75%	6800	16.568	220348.5	3.77%
ISHARES MSCI AC FAR EAST XJP	1720	51.03	171666.33	2.88%	1720	49.38	166115.68	2.84%
ISHARES MSCI TAIWAN	3823	39.06	292057.01	4.90%	3823	38.03	284355.56	4.86%
ISHARES MSCI KOREA	3562	42.555	296466.49	4.97%	3562	40.465	281906.16	4.82%
AMUNDI ETF MSCI INDIA UCITS ETF - EUR	260	518.8	263818	4.42%	260	489.7	249020.19	4.26%
LYXOR ETF MSCI TAIWAN	5800	13.058	148127.52	2.48%	5800	12.668	143703.44	2.46%
LYXOR BRAZIL (IBOVESPA) UCITS ETF	3000	19.302	113254.29	1.90%	3000	19.278	113113.47	1.93%
LYXOR ETF MSCI MALAYSIA	7994	15.118	236368.49	3.96%	7994	15.178	237306.58	4.06%
LYXOR ETF KOREA	608	59.98	71324.9	1.20%	608	56.94	67709.9	1.16%
LYXOR ETF MSCI INDIA	2480	16.568	80362.39	1.35%	2480	15.618	75754.46	1.30%
LYXOR ETF MSCI AC ASIA PACIFIC EX JAPAN	1524	54.75	163192.5	2.74%	1524	52.87	157588.81	2.70%
ISHARES STOXX EUROPE 600 AUTOMOBILES & PARTS UCITS ETF	1300	62.49	158885.76	2.66%	1300	59.39	151003.77	2.58%
ISHARES NIKKEI 225	5000	16.998	166225.99	2.79%	5000	16.772	164015.9	2.81%
ISHARES JPM EMERG BOND	1200	91.362	214426.25	3.60%	1200	90.904	213351.32	3.65%
			5 324 638.33	89.29%			5 214 841.75	89.19%

Репо сделки

През периода не са сключвани договори за репо сделки, както и няма прекратени такива договори; не са закупувани, 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:

09.3.2018 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.