

ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ НОВИ АКЦИИ”

01.12.2017 г. - 31.12.2017 г.

Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на месец декември нетните активи на фонда са 8 699 508.55 лв., което представлява увеличение от 297 445.2241 лв. спрямо края на месец ноември. Броят на емитираните дялове се увеличава с 983.5982 до 11 192 022.1510.

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

Изменение	Q4 2016	Q1 2017	Q2 2017	Q3 2017	Q4 2017	Декември 2017
SOFIX	16.22%	8.1%	11.0%	-2.2%	-1.5%	1.87%
CROBEX	2.76%	-0.3%	-6.2%	-2.9%	1.8%	-1.7%
BELEX 15	12.74%	2.1%	-2.9%	1.3%	5.4%	2.13%
BET-XT	2.50%	13.0%	-1.6%	2.9%	0.0%	0.0%
ISE 100	2.16%	13.8%	12.9%	2.5%	12.5%	11.35%
ДФ Скай Нови Акции	-2.50%	7.41%	4.82%	0.365%	0.0%	2.61%
Средно аритметично за индексите	7.27%	7.35%	2.63%	0.32%	3.64%	2.73%
Дял на съответната държава от активите на фонда	31.12.2016	31.3.2017	30.6.2017	30.9.2017	31.12.2017	
България	16.14%	16.92%	16.58%	16.46%	16.20%	
Хърватска	5.78%	6.06%	5.72%	5.50%	6.04%	
Сърбия	3.00%	2.84%	3.36%	4.52%	3.85%	
Румъния	28.08%	29.07%	26.73%	28.54%	28.53%	
Турция	25.85%	25.43%	28.47%	23.38%	23.10%	
Словения	9.98%	9.50%	9.33%	9.56%	9.96%	
Други	3.69%	3.47%	3.13%	5.37%	5.34%	

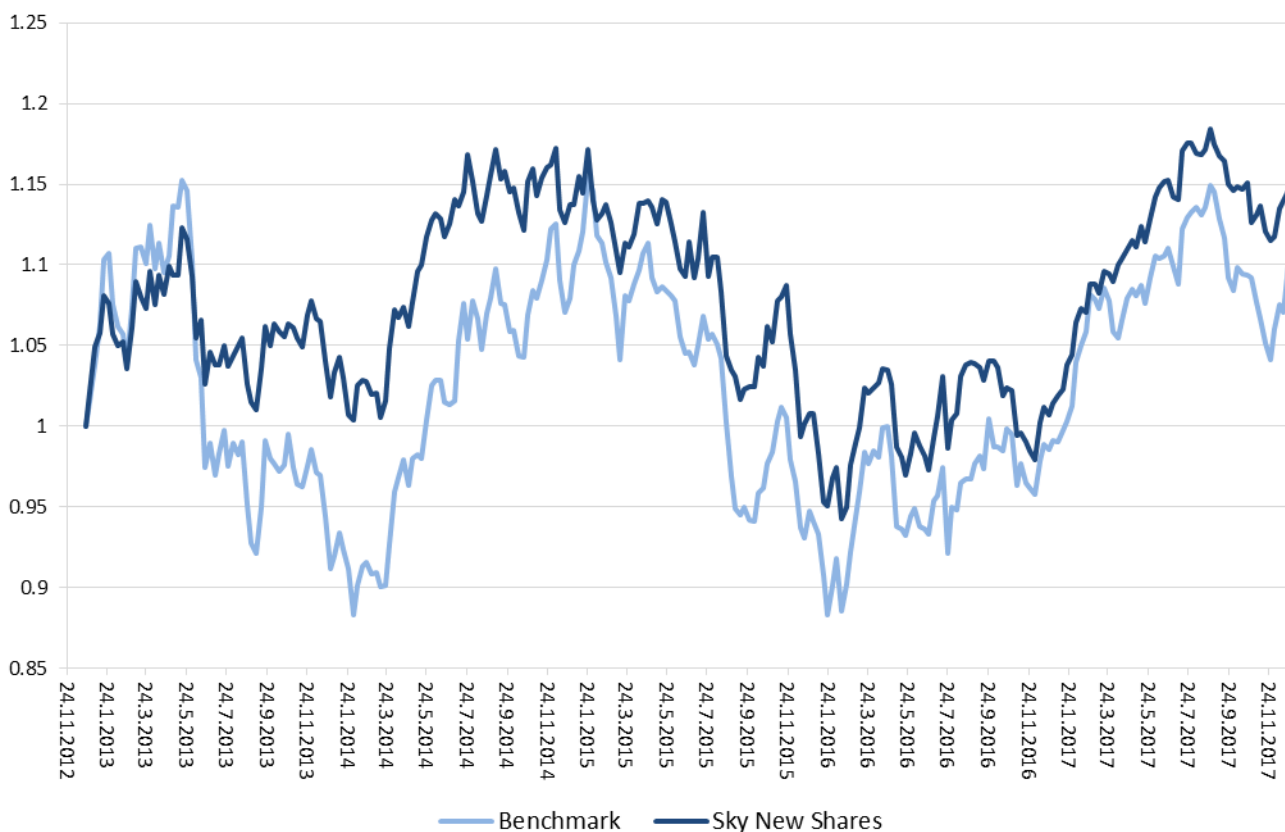
Информация за паричните средства

Към 31.12.2017 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	8.55%	15.52%	46.98%
CROBEX	10.99%	-7.62%	9.07%
BELEX 15	6.88%	5.91%	17.96%
BET-XT	11.75%	14.48%	15.02%
ISE 100	14.75%	48.18%	61.43%
Служебен бенчмарк	8.39%	15.30%	30.09%
ДФ Скай Нови Акции	6.36%	13.00%	13.71%

Стандартното отклонение е измерено на седмична база за последните 52 седмици. Промяната на индексите е в местна валута. До голяма степен именно поради значителния спад на някои валути към еврото се дължи и голямото разминаване между представянето на фонда и индексите, измерени в местна валута. На долната графика това изменение на валутите е изчистено, като служебния бенчмарк е представен в лева.

Движение на цената на фонда спрямо служебния бенчмарк в лева за последните 5 години


Служебният бенчмарк представлява промяната във възвращаемостта на индексите ISE 100, SOFIX, BET-XT и CROBEX взети с равно тегло.

Слабата корекция от ноември отшумя през последния месец на годината. Особено добре се представиха развиващите се пазари. От една страна за това допринесе приемането на новите данъчни закони в САЩ, което макар и калкулирано от пазарите като доста вероятно събитие, все пак вкарваше несигурност през ноември. От друга страна данните за световната икономика все повече говорят за ускоряване на синхронизирания икономически растеж в глобален мащаб. Това съчетано с все още доста експанзионистична парична политика на основните централни банки създава положителни емоции на пазарите.

Централните банки и в Европа и в САЩ прилагат доста плавен подход на нормализиране на паричната политика. Доста ниската инфлация, въпреки значителните парични стимули им дава възможност за маневриране и да не избързват със затягането. Това от своя страна задържа доларът на относително ниски равнища и намалява усещането на риск в развиващите се пазари. В същото време кривата на доходността на държавните облигации стана леко по-стръмна. Т.е. лихвите по дългосрочните облигации леко се покачи през месеца, което пък създаде стимул за покачване на банковите акции. Банките печелят при по-голяма разлика между краткосрочните и дългосрочните лихвени проценти. А финансовият, е най-силно представения в индексите на доста развиващи се пазари.

Представяне на фонда за последната година - по месеци

Доходност по месеци	Средно аритметично за индексите	DFNEW
Декември 2016	3.35%	3.07%
Януари 2017	4.59%	4.02%
Февруари 2017	3.07%	2.64%
Март 2017	-0.32%	0.60%
Април 2017	1.10%	2.31%
Май 2017	1.82%	1.92%
Юни 2017	-0.34%	0.52%
Юли 2017	3.30%	2.83%
Август 2017	0.10%	0.00%
Септември 2017	-2.95%	-2.39%
Октомври 2017	1.76%	-1.21%
Ноември 2017	-0.80%	-1.35%
Декември 2017	2.73%	2.61%

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

Активи	30.9.2017	31.10.2017	30.11.2017	31.12.2017	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права и КИС	8 115 935	7 909 797	7 806 664	8 114 752	93.03%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	570 133	612 676	616 855	607 122	6.96%
Депозити до 3 мес.	0	0	0	0	0.00%
Вземания	9 460	40 727	991	1 121	0.01%
Разходи за бъдещи периоди	518	345	176	0	0.00%
Общо:	8 696 046	8 563 544	8 424 687	8 722 995	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “СКАЙ Нови Акции” финансови инструменти

Дружество	30.11.2017			31.12.2017			
	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							
ИД ЕЛАНА ВИСОКОДОХОДЕН ФОНД	3316	110.92	367821	3316	110.13	365205	4.19%
СОФАРМА АД - СОФИЯ	85035	4.27	363099	85035	4.28	364120	4.17%
АЛБЕНА АД	1213	61.60	74722	1213	62.50	75808	0.87%
ЗЪРНЕНИ ХРАНИ БЪЛГАРИЯ АД	9766	0.33	3203	9766	0.36	3555	0.04%
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	110275	0.55	60651	110275	0.61	66716	0.76%
МОНБАТ АД	20000	10.92	218300	20000	10.34	206760	2.37%
Монбат АД права				20000	0.00	40	0.00%
СОФИЯ КОМЕРС - ЗАЛОЖНИ КЪЩИ 2	4812	3.45	16601	4812	3.65	17564	0.20%
ХИМИМПОРТ АД	62578	1.68	105319	62578	1.78	111139	1.27%

¹ Цени в съответната валута

ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.00	149	149450	0.00	149	0.00%
ЧЕЗ РАЗПРЕДЕЛЕНИЕ БЪЛГАРИЯ АД	572	272.50	155871	572	273.25	156296	1.79%
ИНДУСТРИАЛЕН ХОЛДИНГ БЪЛГАРИЯ АД	48333	0.94	45288	48333	0.95	45723	0.52%
ОБЩО:			1411025			1413075	16.20%
АКЦИИ ХЪРВАТСКА							
KONCHAR ELECTROINDUSTRIJA D.D.	844	703.54	153719	844	714.95	158626	1.82%
KONCHAR TRANSFORMATORI	412	1551.03	165430	412	1640.00	177623	2.04%
DURO DAKOVIC HOLDING	1000	20.50	5307	1000	19.49	5124	0.06%
ATLANSKA PLOVITVA D.D. DUBROVNIK	730	585.98	110739	730	638.90	122606	1.41%
ADRIS P-A	560	444.00	64368	560	429.00	63154	0.72%
ОБЩО:			499563			527133	6.04%
АКЦИИ РУМЪНИЯ							
CNTEE TRANSELECTRICA SA	29275	26.55	327095	29275	24.55	301740	3.46%
TRANSGAZ SA MEDIAS	900	398.00	150743	900	384.00	145097	1.66%
PETROM BUCURESTI	3000000	0.29	362339	3000000	0.29	360224	4.13%
S.N.G.N. ROMGAZ S.A.	5000	31.90	67123	5000	31.30	65705	0.75%
SIF OLTENIA CRAIOVA	335000	2.13	299582	335000	2.18	306610	3.51%
SIF TRANSILVANIA /SIF 3/	400000	0.25	41242	400000	0.24	40809	0.47%
SIF MOLDOVA BACAU	468000	1.36	267853	468000	1.41	277045	3.18%
SIF BANAT CRISANA /SIF 1/	250000	2.57	270386	250000	2.77	290740	3.33%
SNO - SANTIERUL NAVAL ORSOVA	17700	2.76	20559	17700	2.90	21550	0.25%
FARMACEUTICA REMEDIA SA	104000	0.34	14662	104000	0.34	15020	0.17%
SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/	1466649	0.85	521549	1466649	0.86	532016	6.10%
BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE BUCURESTI	24420	12.94	132982	24420	12.90	132257	1.52%
ОБЩО			2476114			2488813	28.53%

АКЦИИ СЪРБИЯ							
VETERINARSKI ZAVOD AD	3017	230.00	11365	3017	200.00	9961	0.11%
NOVOSADSKI SAJAM A.D. NOVI SAD	1745	450.00	12861	1745	402.00	11581	0.13%
NIS AD NOVI SAD	3881	697.00	44305	3881	724.00	46387	0.53%
RTC LUKA LEGET A.D.	223	3120.74	11398	223	3120.74	11489	0.13%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	3210	1850.00	97263	3210	1900.00	100687	1.15%
ALFA PLAM A.D. VRANJE	266	35500.00	154662	266	35506.00	155918	1.79%
AGROBANKA A.D. BEOGRAD	132	0.01	0	132	0.01	0	0.00%
ОБЩО			331854			336022	3.85%
АКЦИИ ТУРЦИЯ							
TURK TRAKTOR	6500	73.50	200351	6500	76.00	212515	2.44%
TAV HAVALIMANLARI	33000	19.52	270138	33000	22.46	318850	3.66%
MIGROS	6000	23.74	59734	6000	27.56	71137	0.82%
ENKA INSAAT VE SANAYI AS	28619	5.64	67689	28619	6.03	74238	0.85%
YAPI VE KREDI BANKASI	63000	4.15	109643	63000	4.34	117623	1.35%
TRAKYA CAM SANAYI A.S	66828	4.13	115744	66828	4.62	132820	1.52%
TURKCELL	15000	15.21	95678	15000	15.48	99891	1.15%
TURKIYE SISE VE CAM FABRIKALARI A.S.	47195	4.19	82928	47195	4.70	95424	1.09%
İŞ BANKASI (C)	33800	6.17	87457	33800	6.97	101347	1.16%
T. GARANTI BANKASI	42500	9.61	171279	42500	10.72	195996	2.25%
EREĞLİ DEMİR CELİK /EREGL	62000	8.61	223865	62000	10.02	267253	3.06%
ARCELİK /ARCLK.E	21000	19.81	174460	21000	21.52	194413	2.23%
ADANA CIMENTO C	219360	0.84	77273	219360	0.84	79268	0.91%
ADANA CIMENTO A	21000	6.38	56186	21000	6.00	54204	0.62%
ОБЩО			1792424			2014981	23.10%

АКЦИИ СЛОВЕНИЯ							
KRKA DD	5475	54.30	581454	5475	57.50	615720	7.06%
ZAVAROVALNICA TRIGLAV	4483	28.89	253307	4483	28.90	253395	2.90%
ОБЩО			834761			869115	9.96%
ISHARES JPM EMERG BOND	1200	84.68	198744	1200	86.83	203790	2.34%
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	1400	95.75	262179	1400	95.62	261823	3.00%
Общо:			460923			465613	5.34%
Общо:			7806664			8114752	93.03%

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:

10.01.2018 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 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.