

ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ НОВИ АКЦИИ”

01.2.2018 г. - 28.2.2018 г.

Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

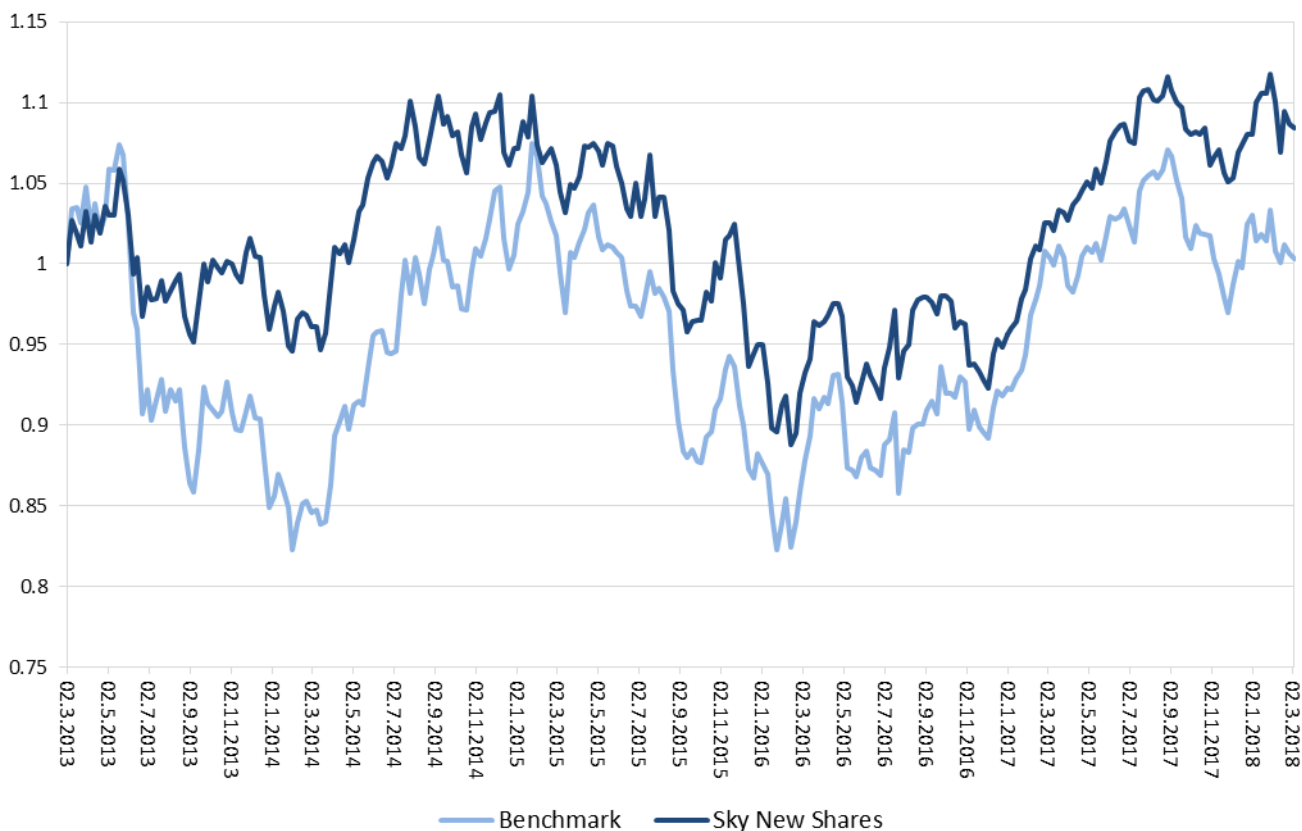
Към края на месец февруари нетните активи на фонда са 8 880 332.9900 лв., което представлява намаление от -111 274.81 лв. спрямо края на месец януари. Броят на емитираните дялове се увеличава с 957.9421 до 11 193 916.5240.

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

Изменение	Q1 2017	Q2 2017	Q3 2017	Q4 2017	Януари 2017	Февруари 2017
SOFIX	8.1%	11.0%	-2.2%	-1.5%	5.21%	-3.69%
CROBEX	-0.3%	-6.2%	-2.9%	1.8%	2.3%	-2.41%
BELEX 15	2.1%	-2.9%	1.3%	5.4%	1.79%	-2.89%
BET-XT	13.0%	-1.6%	2.9%	0.0%	8.1%	0.17%
ISE 100	13.8%	12.9%	2.5%	12.5%	3.23%	-0.48%
ДФ Скай Нови Акции	7.41%	4.82%	0.365%	0.0%	4.27%	-1.24%
Средно аритметично за индексите	7.35%	2.63%	0.32%	3.64%	4.11%	-1.86%
ДФ Скай Нови Акции стандартно отклонение						7.99%
Дял на съответната държава от активите на фонда	31.3.2017	30.6.2017	30.9.2017	31.12.2017	31.01.2018	28.02.2018
България	16.92%	16.58%	16.46%	16.20%	16.36%	15.79%
Хърватска	6.06%	5.72%	5.50%	6.04%	5.95%	6.03%
Сърбия	2.84%	3.36%	4.52%	3.85%	3.74%	3.79%
Румъния	29.07%	26.73%	28.54%	28.53%	29.98%	29.82%
Турция	25.43%	28.47%	23.38%	23.10%	22.26%	23.02%
Словения	9.50%	9.33%	9.56%	9.96%	10.03%	10.14%
Други	3.47%	3.13%	5.37%	5.34%	5.17%	5.08%

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

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 разминаването 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.

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.

Представяне на фонда за последната година - по месеци

Доходност по месеци	Средно аритметично за индексите	DFNEW
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%
Януари 2018	4.11%	4.27%
Февруари 2018	-1.86%	-1.24%

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

Активи	30.11.2017	31.12.2017	31.1.2018	28.2.2018	Структура на активите спрямо общата им стойност към 28.02.2018 г. /%/
Акции и права и КИС	7 806 664	8 114 752	8 430 083	8 339 530	93.66%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	616 855	607 122	584 628	561 907	6.31%
Депозити до 3 мес.	0	0	0	0	0.00%
Вземания	991	1 121	999	691	0.01%
Разходи за бъдещи периоди	176	0	2 013	1 845	0.02%
Общо:	8 424 687	8 722 995	9 017 723	8 903 972	100.00%

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.

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

Дружество	31.1.2018			28.2.2018			
	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	111.19	368718	3316	108.53	359889	4.04%
СОФАРМА АД - СОФИЯ	85035	4.25	361569	85035	4.13	350769	3.94%
АЛБЕНА АД	1213	63.00	76419	1213	61.00	73993	0.83%
ЗЪРНЕНИ ХРАНИ БЪЛГАРИЯ АД	9766	0.40	3858	9766	0.36	3526	0.04%
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	110275	0.66	72782	110275	0.61	67268	0.76%
МОНБАТ АД	20000	10.63	212500	20000	9.60	192020	2.16%
СОФИЯ КОМЕРС - ЗАЛОЖНИ КЪЩИ 2	4812	3.57	17155	4812	3.52	16938	0.19%
ХИМИМПОРТ АД	62578	2.45	153097	62578	2.35	146871	1.65%
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.00	149	149450	0.00	149	0.00%
ЧЕЗ РАЗПРЕДЕЛЕНИЕ БЪЛГАРИЯ АД	572	275.00	157300	572	253.36	144919	1.63%
ИНДУСТРИАЛЕН ХОЛДИНГ БЪЛГАРИЯ АД	48333	1.07	51861	48333	1.02	49275	0.55%
ОБЩО:			1475408			1405618	15.79%
АКЦИИ ХЪРВАТСКА							
KONCHAR ELECTROINDUSTRIJA D.D.	844	700.00	155467	844	690.00	152875	1.72%
KONCHAR TRANSFORMATORI	412	1730.00	187560	412	1820.00	196841	2.21%
DURO DAKOVIC HOLDING	1000	16.50	4342	1000	16.35	4292	0.05%
ATLANSKA PLOVITVA D.D. DUBROVNIK	730	654.00	125631	730	630.00	120728	1.36%

¹ Цени в съответната валута

ADRI P-A	560	432.00	63660	560	420.00	61742	0.69%
ОБЩО:			536660			536479	6.03%
АКЦИИ РУМЪНИЯ							
CNTEE TRANSELECTRICA SA	29275	26.55	326603	29275	24.90	305747	3.43%
TRANSGAZ SA MEDIAS	900	426.00	161105	900	408.00	154017	1.73%
PETROM BUCURESTI	3000000	0.31	386376	3000000	0.31	390075	4.38%
S.N.G.N. ROMGAZ S.A.	5000	34.20	71855	5000	36.50	76547	0.86%
SIF OLTENIA CRAIOVA	335000	2.47	346992	335000	2.33	327391	3.68%
SIF TRANSILVANIA /SIF 3/	400000	0.25	41936	400000	0.25	41105	0.46%
SIF MOLDOVA BACAU	468000	1.56	306781	468000	1.57	307400	3.45%
SIF BANAT CRISANA /SIF 1/	250000	3.06	321455	250000	2.88	301994	3.39%
SNO - SANTIERUL NAVAL ORSOVA	17700	2.78	20676	17700	2.90	21530	0.24%
FARMACEUTICA REMEDIA SA	104000	0.32	13984	104000	0.39	16838	0.19%
SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/	1466649	0.92	566986	1466649	0.93	569028	6.39%
BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE BUCURESTI	24420	13.50	138528	24420	14.00	143397	1.61%
ОБЩО			2703277			2655068	29.82%
АКЦИИ СЪРБИЯ							
VETERINARSKI ZAVOD AD	3017	187.00	9293	3017	160.00	7997	0.09%
NOVOSADSKI SAJAM A.D. NOVI SAD	1745	450.00	12934	1745	450.00	13009	0.15%
NIS AD NOVI SAD	3881	717.00	45834	3881	715.00	45971	0.52%
RTC LUKA LEGET A.D.	223	3120.74	11463	223	3120.74	11529	0.13%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	3210	1900.00	100458	3210	1885.00	100243	1.13%
ALFA PLAM A.D. VRANJE	266	35800.00	156851	266	36000.00	158643	1.78%
AGROBANKA A.D. BEOGRAD	132	0.01	0	132	0.01	0	0.00%
ОБЩО			336832			337392	3.79%

АКЦИИ ТУРЦИЯ							
TURK TRAKTOR	6500	79.00	214910	6500	77.60	212379	2.39%
TAV HAVALIMANLARI	33000	22.14	305779	33000	23.20	322357	3.62%
MIGROS	6000	26.22	65842	6000	24.08	60834	0.68%
ENKA INSAAT VE SANAYI AS	28619	5.65	67673	28619	5.49	66154	0.74%
YAPI VE KREDI BANKASI	63000	4.66	122869	63000	4.76	126265	1.42%
TRAKYA CAM SANAYI A.S	66828	4.83	135089	66828	4.85	136470	1.53%
TURKCELL	15000	15.61	97996	15000	15.34	96884	1.09%
TURKIYE SISE VE CAM FABRIKALARI A.S.	47195	5.00	98761	47195	4.78	94986	1.07%
İŞ BANKASI (C)	33800	8.05	113875	33800	7.60	108160	1.21%
T. GARANTI BANKASI	42500	12.29	218603	42500	11.73	209905	2.36%
EREĞLİ DEMİR ÇELİK /EREGL	62000	9.95	258185	62000	11.36	296555	3.33%
ARCELİK /ARCLK.E	21000	19.06	167517	21000	18.95	167558	1.88%
ADANA CIMENTO C	219360	0.93	85380	219360	1.04	96056	1.08%
ADANA CIMENTO A	21000	6.24	54843	21000	6.20	54821	0.62%
ОБЩО			2007322			2049384	23.02%
АКЦИИ СЛОВЕНИЯ							
KRKA DD	5475	58.60	627499	5475	58.20	623215	7.00%
ZAVAROVALNICA TRIGLAV	4483	31.60	277068	4483	31.90	279699	3.14%
ОБЩО			904567			902914	10.14%
ДРУГИ							
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	1200	91.97	215853	1200	86.82	203766	2.29%
ISHARES JPM EMERG BOND	1400	91.36	250164	1400	90.90	248910	2.80%
Общо:			466017			452676	5.08%
Общо:			8430083			8339530	93.66%

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:

09.03.2018 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.