

ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ ГЛОБАЛ ЕТФС ”

01.8.2020 г. - 31.8.2020 г.

Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на месец август нетните активи на фонда са 5 388 637.28 лв., което представлява увеличение от 28 043.71 лв. спрямо края на месец юли. Броят на емитираните дялове остават без промяна на 26 017.3332.

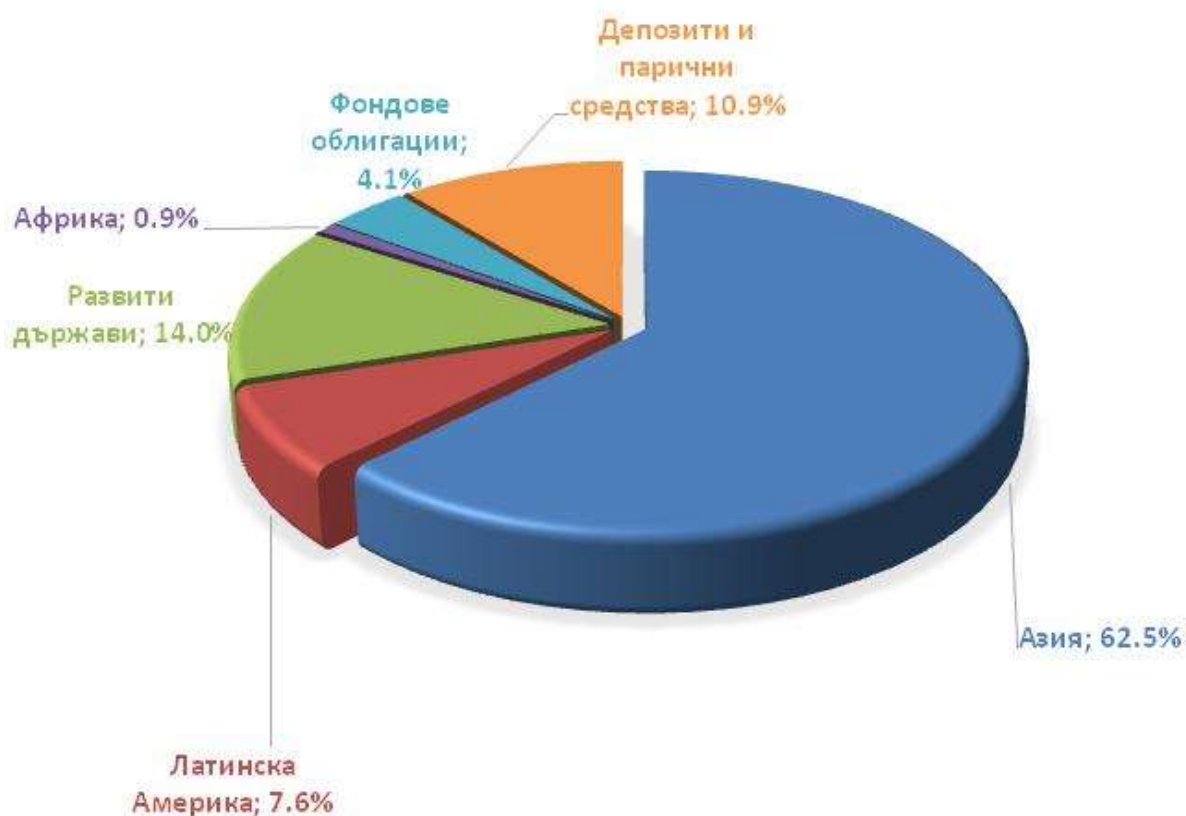
Представяне на индексите на развиващите се пазари в евро

| MSCI Index | MTD | 3MTD | YTD | 1 Yr | 3 Yr | 5 Yr | 10 Yr |
|---------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Китай | 4.4% | 15.9% | 10.7% | 24.2% | 7.0% | 10.0% | 5.8% |
| Индия | 2.3% | 13.1% | -11.8% | -6.3% | -0.9% | 2.4% | 2.3% |
| Индонезия | 1.3% | 5.3% | -26.6% | -25.4% | -7.6% | 0.3% | -0.3% |
| Корея | 0.9% | 9.8% | -5.2% | 11.6% | -1.1% | 6.0% | 4.6% |
| Малайзия | -4.8% | -0.7% | -12.4% | -12.9% | -4.9% | -2.5% | -2.2% |
| Филипини | -0.3% | -1.8% | -26.2% | -27.0% | -8.2% | -5.9% | 4.1% |
| Тайван | -3.2% | 13.7% | 2.9% | 23.5% | 8.3% | 10.7% | 7.8% |
| Тайланд | -3.8% | -10.3% | -28.7% | -31.7% | -5.9% | -0.1% | 2.9% |
| Бразилия | -10.1% | 3.5% | -41.1% | -33.1% | -9.5% | 2.5% | -7.1% |
| Чили | -10.8% | -1.5% | -29.9% | -34.8% | -19.6% | -7.9% | -8.5% |
| Колумбия | 2.0% | 0.0% | -45.8% | -40.3% | -14.4% | -6.4% | -9.1% |
| Мексико | -0.8% | -4.5% | -31.3% | -27.1% | -17.0% | -10.1% | -3.0% |
| Перу | 6.0% | 5.2% | -29.7% | -26.5% | -7.6% | 5.4% | -0.5% |
| Латинска Америка | -7.4% | 1.4% | -37.7% | -31.5% | -12.5% | -2.5% | -6.4% |
| Чехия | 3.4% | 1.2% | -27.3% | -24.9% | -8.2% | -8.5% | -7.2% |
| Унгария | -3.6% | -5.5% | -33.7% | -19.9% | -8.8% | 6.9% | 0.1% |
| Полша | 2.9% | 5.3% | -20.3% | -17.9% | -12.4% | -5.2% | -3.8% |
| Русия | -0.9% | -8.7% | -29.6% | -18.4% | 2.3% | 4.9% | -1.6% |
| Турция | -9.4% | -16.5% | -35.2% | -29.1% | -27.0% | -14.9% | -10.8% |
| Египет | 7.2% | -0.4% | -23.6% | -21.6% | -3.7% | -5.3% | -3.0% |
| Южна Африка | -2.4% | 7.3% | -26.6% | -20.4% | -11.6% | -6.0% | -1.8% |
| Развиваща се Азия | 1.9% | 12.8% | 1.0% | 13.1% | 3.7% | 7.5% | 5.1% |
| Развиващи се пазари | 0.9% | 10.1% | -7.3% | 3.0% | 0.2% | 4.7% | 1.9% |

Към 31.8.2020 г.

Традиционно скучния август изненада тази година, като пазарите претърпяха значителни изменения. Повечето развити пазари отбелязаха едни от най-силните си месечни ръстове за последните години. За това допринесоха три фактора, от една страна резултатите на компаниите за второто тримесечие се оказаха не чак толкова катастрофални, колкото се опасяваше пазара. От друга страна ФЕД продължава да дава сигнали, че ниските лихви ще продължат за дълъг период от време, което

едновременно силно подpira пазара на акции и води до обезценка на долара. Последният фактор, който налива оптимизъм на пазара е развитието около COVID -19 . Все по-малко вероятно става налагането на повсеместни локдауни в САЩ, които се основната причина за влошаване на икономиката. Същевременно оптимизмът около потенциалните ваксини за вируса, прави по-малко вероятно ситуацията на потиснато потребление и трудов пазар да продължи и през 2021 г. Развиващите се пазари обаче не бяха толкова хомогенно оптимистични. Източна Азия, особено Южна Корея, Тайван и Индокитай, са зависими от добрите отношения между САЩ и Китай. И напрежението между двете велики сили, оказва неблагоприятно влияние върху пазарите им. От друга страна Латинска Америка е силно засегната от COVID – 19, а централните банки там имат доста по-ограничен арсенал с възможни действия. Това създава сериозна волатилност на пазарите там.

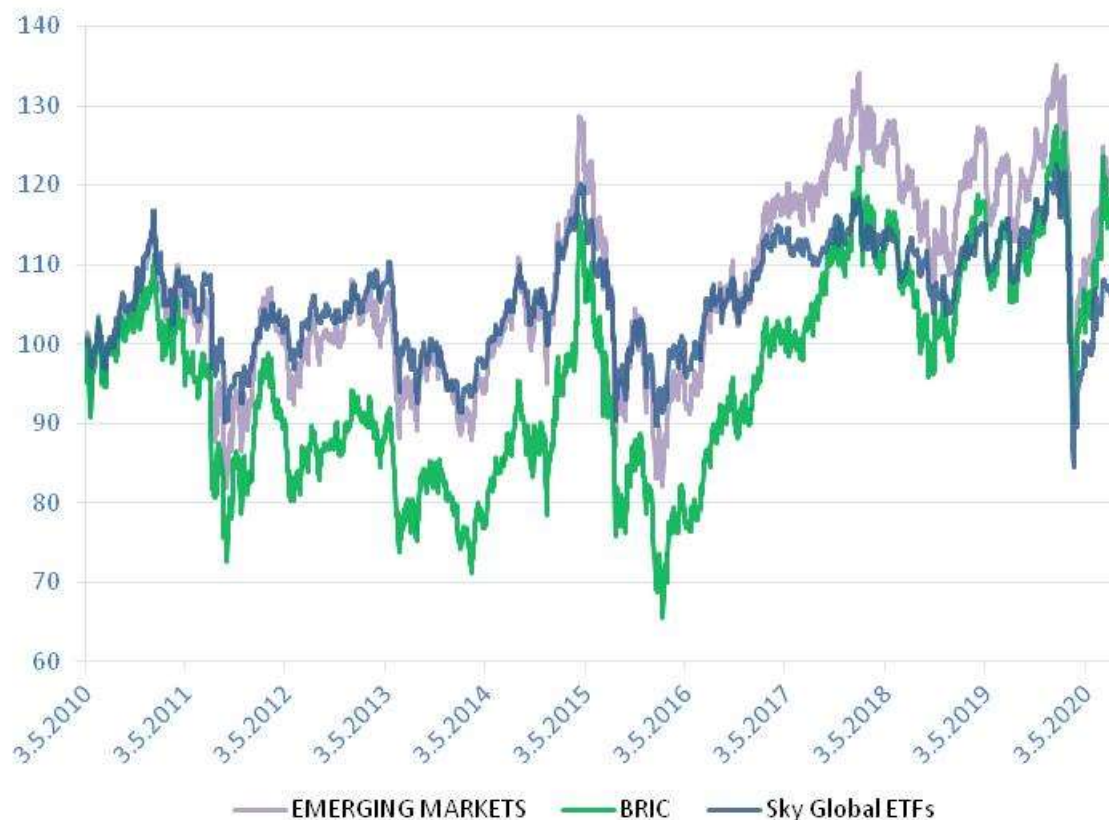


Стойност на портфейла в началото и в края на отчетния период в лева

| Активи | 30.6.2020 | 31.7.2020 | 31.8.2020 | Структура на активите спрямо общата им стойност /%/ |
|-----------------------------|-----------|-----------|-----------|---|
| Дялове в КИС, акции и права | 4 710 135 | 4 774 706 | 4 809 294 | 89.06% |
| Облигации | 0 | 0 | 0 | 0.00% |
| Парични средства | 600 316 | 596 302 | 590 019 | 10.93% |
| Депозити до 3 мес. | 0 | 0 | 0 | 0.00% |
| Вземания | 0 | 0 | 0 | 0.00% |
| Други | 1 146 | 953 | 760 | 0.01% |
| Общо: | 5 311 597 | 5 371 961 | 5 400 073 | 100.00% |

Информация за паричните средства

Към 31.8.2020 г. Фондът 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 2019 | Q2 2019 | Q3 2019 | Q4 2019 | Q1 2020 | Q2 2020 | Юли 2020 | Август 2020 |
|---|---------|---------|---------|---------|---------|---------|----------|-------------|
| Доходност MSCI EM | 11.5% | -1.71% | -0.88% | 8.15% | -22.1% | 14.6% | 3.0% | 0.94% |
| Доходност ДФ Скай Глобал ETFs | 6.97% | 1.57% | 1.26% | 4.80% | -24.53% | 14.72% | 3.34% | -1.24% |
| Стандартно отклонение* на ДФ Скай Глобал ETFs | | | | | | | | 23.95% |

* Стандартното отклонение е измерено на седмична база за последните 52 седмици

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

| Company | 31.7.2020 | | | | 31.8.2020 | | | |
|--|------------------|---------------------------|-------------------------|---------------------|------------------|---------------------------|-------------------------|---------------------|
| | 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 MSCI MALAYSIA UCITS | 7994 | 13.23 | 206849.79 | 3.85% | 7994 | 12.606 | 197093.6 | 3.65% |
| LYXOR MSCI ASIA PACIFIC | 1524 | 54.67 | 162954.04 | 3.03% | 1524 | 56.11 | 167246.23 | 3.10% |
| LYXOR MSCI KOREA-C-EUR | 608 | 51.92 | 61740.39 | 1.15% | 608 | 52.98 | 63000.88 | 1.17% |
| LYXOR MSCI BRAZIL UCITS ETF | 3000 | 14.812 | 86909.26 | 1.62% | 3000 | 13.448 | 78906.01 | 1.46% |
| LYXOR MSCI TAIWAN | 5800 | 17.388 | 197246.24 | 3.67% | 5800 | 16.876 | 191438.21 | 3.55% |
| AMUNDI ETF MSCI INDIA UCITS ETF - EUR | 260 | 461.05 | 234451.21 | 4.36% | 260 | 474.7 | 241392.45 | 4.47% |
| LYXOR INTL PAN AFRICA UCITS C EUR | 3000 | 8.448 | 49568.56 | 0.92% | 3000 | 8.374 | 49134.36 | 0.91% |
| AMUNDI FUNDS ASIA EQUITY CONCENTRATED - A2 USD | 8274.722 | 34.74 | 474536.68 | 8.83% | 8274.722 | 35.89 | 486467.71 | 9.01% |
| DB X-TRACKERS MSCI SINGAPORE UCITS ETF | 53000 | 1.042 | 108012.67 | 2.01% | 53000 | 1.0492 | 108759.01 | 2.01% |

¹ Цена в оригинална валута

| | | | | | | | | |
|--|---------|---------|-----------|-------|---------|---------|-----------|-------|
| XTRACKERS MSCI PHILIPPINES UCITS ETF | 25600 | 1.235 | 61835.52 | 1.15% | 25600 | 1.2286 | 61515.08 | 1.14% |
| MULTI UNITS LUXEMBOURG-LYXOR ETF AUSTRALIA (S&P ASX 200) | 2500 | 36.605 | 178982.89 | 3.33% | 2500 | 38.145 | 186512.84 | 3.45% |
| XTRACKERS MSCI INDONESIA SWAP UCITS ETF | 5499 | 10.296 | 110734.6 | 2.06% | 5499 | 10.64 | 114434.36 | 2.12% |
| XTRACKERS MSCI MEXICO UCITS ETF | 21565 | 2.764 | 116578.54 | 2.17% | 21565 | 2.7815 | 117316.65 | 2.17% |
| UBS ETF - MSCI PACIFIC (EX JAPAN) UCITS ETF (USD) A-DIS | 2200 | 32.87 | 141433.89 | 2.63% | 2200 | 33.72 | 145091.29 | 2.69% |
| DB X-TRACKERS FTSE VIETNAM ETF | 845 | 21.945 | 36267.99 | 0.68% | 845 | 23.075 | 38135.52 | 0.71% |
| AMUNDI FUNDS ASEAN NEW MARKETS-C (USD) | 1720.45 | 72.03 | 204570.04 | 3.81% | 1720.45 | 72.27 | 203670.09 | 3.77% |
| XTRACKERS MSCI TAIWAN UCITS ETF | 3833 | 32.765 | 245629.27 | 4.57% | 3833 | 31.89 | 239069.65 | 4.43% |
| XTRACKERS MSCI KOREA UCITS ETF | 1301 | 59.33 | 150967.25 | 2.81% | 1301 | 60.2 | 153181 | 2.84% |
| FIDELITY FUNDS-INDONESIA FUND A (USD) | 1500 | 22.43 | 55540.16 | 1.03% | 1500 | 22.75 | 55898.46 | 1.04% |
| ISHARES MSCI MEXICO CAPPED UCITS ETF USD | 550 | 67.49 | 72599.43 | 1.35% | 550 | 67.77 | 72900.63 | 1.35% |
| iSHARES MSCI CANADA B | 1307 | 108.28 | 276792.9 | 5.15% | 1307 | 113.22 | 289420.87 | 5.36% |
| ISHARES MSCI AC FAR EAST EX-JAPAN SMALL CAP | 1100 | 21.3075 | 50904.83 | 0.95% | 1100 | 22.0825 | 53019.91 | 0.98% |
| ISHARES JPM EMERG BOND | 1200 | 94.7 | 222260.52 | 4.14% | 1200 | 94.122 | 220903.96 | 4.09% |
| ISHARES MSCI EM LATIN AMERICA UCITS ETF | 6800 | 11.27 | 149886.99 | 2.79% | 6800 | 10.63 | 141375.22 | 2.62% |
| ISHARES MSCI AC FAR EAST XJP | 1720 | 49.385 | 166132.5 | 3.09% | 1720 | 50.63 | 170320.72 | 3.15% |
| ISHARES MSCI TAIWAN | 3823 | 49.225 | 368062.13 | 6.85% | 3823 | 47.67 | 356435.17 | 6.60% |

| | | | | | | | | |
|--|------|--------|------------|--------|------|--------|------------|--------|
| ISHARES MSCI KOREA | 3562 | 36.02 | 250939.33 | 4.67% | 3562 | 36.725 | 255850.83 | 4.74% |
| LYXOR ETF MSCI INDIA | 2480 | 14.632 | 70971.91 | 1.32% | 2480 | 15.052 | 73009.1 | 1.35% |
| ISHARES STOXX EUROPE 600 AUTOMOBILES & PARTS UCITS ETF | 1300 | 35.665 | 90681.08 | 1.69% | 1300 | 39.48 | 100381.02 | 1.86% |
| ISHARES NIKKEI 225 | 5000 | 17.452 | 170665.73 | 3.18% | 5000 | 18.142 | 177413.34 | 3.29% |
| | | | 4774706.34 | 88.88% | | | 4809294.17 | 89.06% |

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:

09.9.2020 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.