

ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ ГЛОБАЛ ETFs ”

01.10.2021 г. - 31.10.2021 г.

Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на месец октомври нетните активи на фонда са 6 524 216 лв., което представлява увеличение от 62 415 лв. спрямо края на месец септември. Броят на емитираните дялове остава без промяна на 24 958.5401.

Представяне на индексите на развиващите се пазари в евро

MSCI Index	MTD	3MTD	YTD	1 Yr	3 Yr	5 Yr	10 Yr
Китай	3.3%	0.2%	-10.3%	-9.9%	8.8%	7.1%	7.0%
Индия	-0.7%	13.2%	31.7%	49.9%	17.6%	10.5%	8.7%
Индонезия	8.4%	23.6%	7.8%	24.3%	2.5%	-1.7%	0.7%
Корея	-2.2%	-8.1%	-5.6%	22.5%	11.3%	7.7%	6.5%
Малайзия	2.5%	8.0%	-4.2%	1.5%	-5.5%	-3.9%	-2.0%
Филипини	3.4%	15.2%	0.2%	7.9%	0.9%	-3.2%	5.4%
Тайван	0.8%	2.4%	21.4%	40.2%	25.7%	15.6%	12.5%
Тайланд	3.1%	8.2%	1.5%	24.2%	-5.8%	0.2%	3.7%
Бразилия	-8.9%	-22.9%	-19.5%	7.3%	-11.8%	-6.4%	-5.8%
Чили	-7.3%	-7.5%	-10.7%	9.1%	-15.0%	-9.0%	-6.9%
Колумбия	2.9%	19.9%	-4.9%	35.3%	-7.0%	-4.4%	-6.1%
Мексико	-0.1%	1.0%	19.9%	45.0%	4.0%	-1.8%	0.7%
Перу	13.5%	12.4%	-14.5%	5.6%	-10.9%	-0.7%	0.4%
Латинска Америка	-5.2%	-13.9%	-9.1%	17.5%	-8.2%	-5.2%	-4.2%
Чехия	-0.9%	13.2%	40.3%	81.9%	6.4%	5.2%	-1.4%
Унгария	2.6%	11.3%	32.8%	78.0%	11.1%	9.4%	8.5%
Полша	4.3%	5.7%	20.1%	58.7%	-1.0%	2.5%	-0.8%
Русия	4.0%	16.9%	38.9%	75.1%	12.7%	10.1%	2.5%
Турция	-0.4%	-2.6%	-18.0%	16.1%	-7.7%	-14.1%	-7.2%
Египет	15.3%	14.9%	10.3%	5.1%	0.8%	-8.7%	1.6%
Южна Африка	-0.3%	-3.3%	7.2%	23.8%	2.7%	-1.7%	0.6%
Развиваща се Азия	1.4%	1.7%	1.2%	10.6%	11.8%	8.0%	7.2%
Развиващи се пазари	1.1%	1.4%	3.6%	15.4%	9.0%	5.8%	4.4%

Към 31.10.2021 г.

Октомври започна колебливо за пазарите. Съвпадащите икономически индикатори излизащи през септември показваха спадове на темповете на растеж на развитите икономики. Инфлацията далеч надхвърля дългосрочните си средни стойности. Лихвените проценти са дълбоко в отрицателна реална доходност. Нарастващите разходи за труд заплашват профит маржините на компаниите. Оценките на компаниите – особено във водещия пазар – САЩ, са на невиджани от интернет бума в началото на 20 век стойности.

През септември всичко това създаде колебания в траекторията на пазарите. Върна на преден план изчезналият от десетилетие призрак на стагфлацията – едновременно висока инфлация и нисък растеж. Всичко това обаче се оказа краткотрайно и доведе само до мини корекция. Оказа се, че опитващите се да познаят бъдещето анализатори са сложили тъмните очила твърде рано.

Излизащите отчети на компании за третото тримесечие в голямата си степен бият очакванията. Централните банки продължават да подържат мнението си, че инфлацията е само временно явление, породено от ниската база през 2020 г. и от проблемите с доставките поради различния темп, с който държавите излизат от пандемията. А пазарът на облигации изглежда им вярва, като десетгодишните американски облигации още се търгуват на под 1.6% доходност. Стабилността на лихвите, вярата че централните банки ще продължат експанзионистичната си политика и най-вече по-добрите от очакваното резултати на компании подкрепиха и пазарът на акции. Реално всички основни индекси завършиха сериозно на положителна територия, като повечето от тях не само компенсиряха септемврийската корекция, но и достигнаха нови върхове.

Все пак към момента нито една от заплахите пред икономиките и пред оценките на компаниите не е отпаднала. Инфлацията продължава да е висока, централните банки в крайна сметка ще се наложи да променят крайно експанзионистичната си политика – намаляването на темпа на изкупуване на държавни облигации от ФЕД и ЕЦБ и последващото спиране на тези програми е почти сигурно, че ще се случи през следващите месеци до година. А новият цикъл на повишаващи се лихвени проценти вече бе започнат от Нова Зеландия и може да се очаква скоро към нея да се присъединят и Великобритания, САЩ и Австралия. Разбирането, че инфлацията е временна дава все още свобода на централните банки да са силно предпазливи във връщането към нормалност на лихвите, а това действа успокоително и на пазарите на акции. Ако обаче тази инфлация се окаже по-упорита е възможно 2022 година да се окаже доста по-волатилна година.



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

Активи	31.8.2021	30.9.2021	31.10.2021	Структура на активите спрямо общата им стойност [%]
Дялове в КИС, акции и права	5 561 605	5 469 154	5 542 124	84.78%
Облигации	0	0	0	0.00%
Парични средства	1 007 151	1 004 962	994 911	15.22%
Депозити до 3 мес.	0	0	0	0.00%
Вземания	0	0	0	0.00%
Други	785	592	392	0.01%
Общо:	6 569 541	6 474 708	6 537 427	100.00%

Информация за паричните средства

Към 31.10.2021 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 2020	Q2 2020	Q3 2020	Q4 2020	Q1 2021	Q2 2021	Q3 2021	Октомври 2021
Доходност MSCI EM	-22.1%	14.6%	4.1%	14.4%	6.1%	3.5%	-6.72%	1.1%
Доходност ДФ Скай Глобал ETFs	-24.53%	14.72%	2.9%	14.3%	7.29%	3.6%	-2.24%	2.2%
Стандартно отклонение* на ДФ Скай Глобал ETFs	10.24%							

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

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

Company	30.9.2021				31.10.2021			
	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 ASIA PACIFIC	1524	65.67	195741.58	3.02%	1524	66.94	199527.05	3.05%
LYXOR MSCI KOREA-C-EUR	608	71.56	85095.19	1.31%	608	69.87	83085.54	1.27%
LYXOR MSCI BRAZIL UCITS ETF	3000	15.36	90124.65	1.39%	3000	14.058	82485.17	1.26%
LYXOR MSCI TAIWAN	5800	25.7	291536.02	4.50%	5800	25.785	292500.24	4.47%
AMUNDI ETF MSCI INDIA UCITS ETF - EUR	260	740	376301.69	5.81%	260	735.7	374115.07	5.72%
LYXOR INTL PAN AFRICA UCITS C EUR	3000	8.794	51598.71	0.80%	3000	9.485	55653.14	0.85%
AMUNDI FUNDS ASIA EQUITY CONCENTRATED - A2 USD	4000	39.99	270191.64	4.17%	4000	40.79	274033.75	4.19%
DB X-TRACKERS MSCI SINGAPORE UCITS ETF	53000	1.3292	137783.53	2.13%	53000	1.395	144604.29	2.21%
XTRACKERS MSCI PHILIPPINES UCITS ETF	25600	1.463	73251.31	1.13%	25600	1.54	77106.64	1.18%

¹ Цена в оригинална валута

MULTI UNITS LUXEMBOURG-LYXOR ETF AUSTRALIA (S&P ASX 200)	2500	47.005	229834.47	3.55%	2500	49.84	243696.42	3.73%
XTRACKERS MSCI INDONESIA SWAP UCITS ETF	5499	11.916	128157.87	1.98%	5499	13.048	140332.66	2.15%
XTRACKERS MSCI MEXICO UCITS ETF	21565	4.323	182333.23	2.82%	21565	4.326	182459.75	2.79%
UBS ETF - MSCI PACIFIC (EX JAPAN) UCITS ETF (USD) A-DIS	2200	40.07	172414.24	2.66%	2200	42.015	180783.23	2.77%
DB X-TRACKERS FTSE VIETNAM ETF	845	37.41	61826.62	0.95%	845	40.195	66429.34	1.02%
XTRACKERS MSCI TAIWAN UCITS ETF	3833	48.08	360441.16	5.57%	3833	48.225	361528.19	5.53%
XTRACKERS MSCI KOREA UCITS ETF	1301	81.92	208448.29	3.22%	1301	80.03	203639.12	3.11%
FIDELITY FUNDS- INDONESIA FUND A (USD)	1500	25.73	65191.59	1.01%	1500	27.42	69079.48	1.06%
ISHARES MSCI MEXICO CAPPED UCITS ETF USD	550	105.32	113293.41	1.75%	550	105.48	113465.52	1.74%
iSHARES MSCI CANADA B	1307	149.08	381088.7	5.89%	1307	160.84	411150.44	6.29%
ISHARES MSCI AC FAR EAST EX-JAPAN SMALL CAP	1100	27.63	69077.82	1.07%	1100	27.71	70559.55	1.08%
ISHARES JPM EMERG BOND	1200	94.604	222035.21	3.43%	1200	94.614	222058.68	3.40%
ISHARES MSCI EM LATIN AMERICA UCITS ETF	6800	12.782	169996.05	2.63%	6800	12.19	162122.66	2.48%
ISHARES MSCI AC FAR EAST XJP	1720	55.34	186165.29	2.88%	1720	56.12	188789.23	2.89%
ISHARES MSCI TAIWAN	3823	69.64	520707.9	8.04%	3823	70.07	523923.07	8.01%
ISHARES MSCI KOREA	3562	48.95	341018.32	5.27%	3562	47.835	333250.49	5.10%
LYXOR ETF MSCI INDIA	2480	23.565	114301.05	1.77%	2480	23.455	113767.5	1.74%

ISHARES STOXX EUROPE 600 AUTOMOBILES & PARTS UCITS ETF	1300	58.32	148283.21	2.29%	1300	61.78	157080.53	2.40%
ISHARES NIKKEI 225	5000	22.795	222915.72	3.44%	5000	21.975	214896.82	3.29%
			5469154.47	84.47%			5542123.57	84.78%

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:

8.11.2021 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.