

## ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ ГЛОБАЛ ETFs ”

01.9.2016 г. - 30.9.2016 г.

### Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на месец септември нетните активи на фонда са 5 477 787.51 лв., което представлява увеличение от 3 222.54 лв. спрямо края на месец август. Броят на емитираните дялове остава без промяна на 26515.3816.

### Представяне на индексите на развиващите се пазари

MSCI Index	MTD	3MTD	YTD	1 Yr	3 Yr	5 Yr	10 Yr
Китай	1.3%	12.1%	2.6%	9.6%	7.7%	9.0%	6.4%
Индия	-1.9%	4.3%	2.3%	3.9%	16.6%	7.5%	5.0%
Индонезия	1.1%	8.2%	20.6%	49.5%	11.9%	3.4%	9.3%
Корея	0.5%	9.7%	11.0%	19.0%	5.0%	7.7%	3.7%
Малайзия	-4.1%	-3.4%	-0.9%	8.9%	-4.6%	1.0%	5.0%
Филипини	-6.5%	-6.7%	2.4%	4.6%	11.2%	16.2%	11.2%
Тайван	1.6%	8.2%	13.5%	18.0%	10.5%	9.1%	3.6%
Тайланд	-4.7%	5.1%	21.2%	16.7%	4.4%	8.9%	8.4%
Бразилия	-0.6%	9.5%	54.5%	51.8%	-5.5%	-5.5%	0.4%
Чили	-1.3%	-2.9%	7.3%	8.8%	-4.9%	-4.3%	2.4%
Колумбия	-1.6%	1.0%	23.2%	13.9%	-16.0%	-7.5%	3.3%
Мексико	-4.2%	-3.8%	-5.8%	-4.8%	-1.8%	3.6%	2.2%
Перу	-0.8%	-0.1%	45.1%	36.9%	11.1%	3.3%	8.7%
Латинска Америка	-1.8%	3.7%	25.8%	24.8%	-4.6%	-3.2%	0.8%
Чехия	1.6%	-1.5%	-9.6%	-17.7%	-7.0%	-8.3%	-4.9%
Унгария	-1.2%	9.5%	17.0%	34.0%	8.6%	7.4%	-2.4%
Полша	-3.2%	0.5%	-8.5%	-18.1%	-10.6%	-3.6%	-5.4%
Русия	2.8%	4.7%	22.3%	19.6%	-7.8%	-2.5%	-6.0%
Турция	-1.7%	-6.3%	0.4%	2.8%	-6.0%	-1.4%	0.6%
Египет	-2.0%	20.2%	9.9%	4.1%	15.8%	11.6%	0.9%
Южна Африка	4.2%	4.3%	16.5%	6.4%	3.3%	3.6%	4.5%
Развиваща се Азия	0.2%	8.6%	7.2%	13.6%	7.7%	7.8%	4.6%
Развиващи се пазари	0.2%	7.1%	10.0%	13.3%	3.3%	4.1%	2.7%

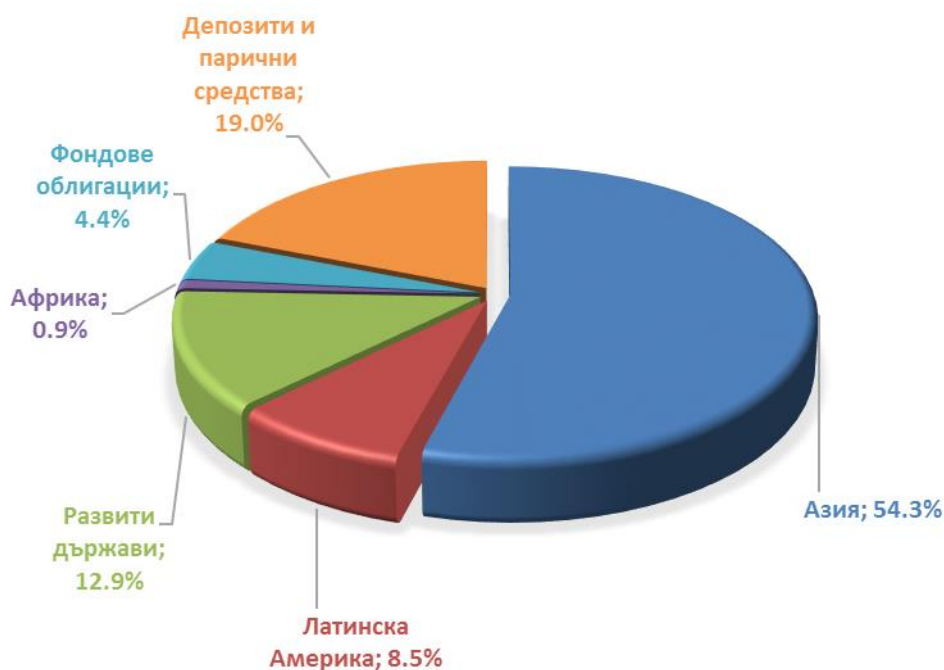
Към 30.9.2016 г.

Търговията в изключително тесен диапазон продължи и през септември. Появилите се за кратко съмнения, че ФЕД може да се окаже по-агресивен във вдигането на лихвите от очакваното, предизвика кратък пик на волатилността в началото на месеца, но в последствие пазарите се успокоиха и липсата на енергия да тръгнат на където и да било се почувства отново.

Поради липсата на новини, които да създадат тренд при акциите, валутните курсове придобиха доста по-голямо от обичайното влияние. Представянето на даден пазар често бе определено от това как се движи местната му валута. Нещо до известна степен рядко срещано, тъй като обикновено валутните курсове имат доста по-слаба волатилност от пазарите на акции.

Доста слабо вероятно е тази липса на посока и слаби колебания да се запазят и през следващите месеци. През октомври започват да излизат отчетите на компаниите за третото тримесечие. Колкото и ФЕД да отлагат вдигането на лихвите, то е сигурно, че и този момент приближава. Ако не променят параметрите на количествените улеснения в Европа, те ще започнат да дават все по-малко резултат. А от тук и по-слабо да въздействат за снижаване на волатилността.

#### Разпределение на активите на фонда по региони



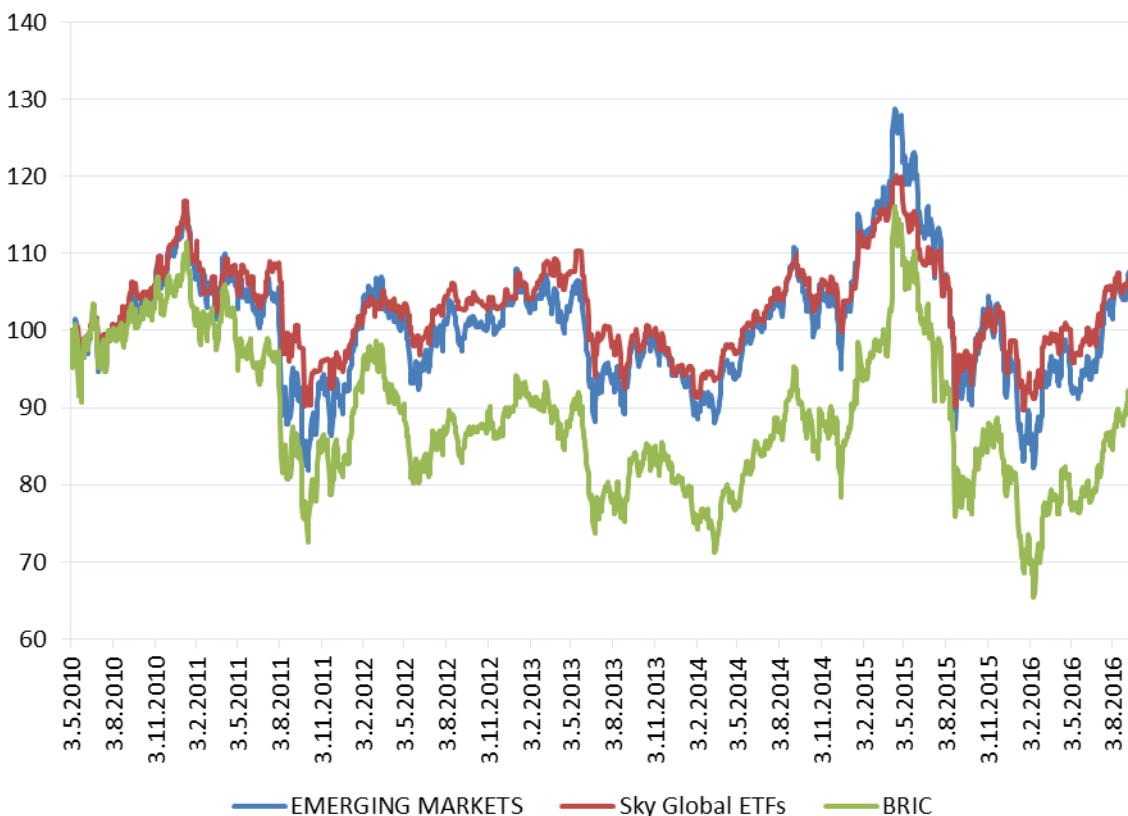
#### Стойност на портфейла в началото и в края на отчетния период в лева

Активи	31.07.2016	31.08.2016	30.09.2016	Структура на активите спрямо общата им стойност %/
Дялове в КИС, акции и права	4 407 405	4 439 737	4 443 240	81.0%
Облигации	0	0	0	0.0%
Парични средства	1 051 372	1 043 909	1 034 515	18.85%
Депозити до 3 мес.	0	0	0	0.00%
Вземания	1 052	0	8 937	0.2%
Други	857	684	516	0.01%
<b>Общо:</b>	<b>5 460 685</b>	<b>5 484 330</b>	<b>5 487 207</b>	<b>100.0%</b>

**Информация за паричните средства**

Към 30.9.2016 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**

	Q1 2015	Q2 2015	Q3 2015	Q4 2015	Q1 2016	Q2 2016	Q3 2016	Септември 2016
Доходност MSCI EM	14.8%	-3.8%	-18.7%	3.03%	0.45%	2.24%	7.08%	0.19%
Доходност ДФ Скай Глобал ETFs	10.23%	-5.4%	-13.6%	4.44%	0.92%	1.88%	4.05%	0.06%
Стандартно отклонение на ДФ Скай Глобал ETFs								15.76%

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

Company	31.8.2016				30.9.2016			
	Брой ценни книжа	Цена за брой <sup>1</sup>	Балансова стойност в лв	Процент от активите	Брой ценни книжа	Цена за брой <sup>1</sup>	Балансова стойност в лв	Процент от активите
LYXOR INTL PAN AFRICA UCITS C EUR	3000	8.46	49638.97	0.91%	3000	8.778	51504.83	0.94%
DB X-TRACKERS MSCI SINGAPORE	53000	1.013	105006.56	1.91%	53000	1.027	106457.78	1.94%
DB X-TRACKERS MSCI PHILIPPINES IM TRN INDEX UCITS ETF	25600	1.903	95281.78	1.74%	25600	1.823	91276.24	1.66%
MULTI UNITS LUXEMBOURG-LYXOR ETF AUSTRALIA (S&P ASX)	2500	38.29	187221.83	3.41%	2500	39.36	192453.67	3.51%
DB X-TRACKERS MSCI INDONESIA TRN INDEX ETF	5499	12.8	137665.4	2.51%	5499	13.14	141322.13	2.58%
DB X-TRACKERS MSCI MEXICO	21565	4.191	176765.79	3.22%	21565	4.061	171282.72	3.12%
DB X-TRACKERS FTSE VIETNAM ETF	845	22	36358.88	0.66%	845	22.06	36458.04	0.66%
DB X-TRACKERS MSCI AC ASIA X-JP	1100	31.27	67274.68	1.23%	1100	31.86	68544.02	1.25%
AMUNDI FUNDS ASEAN NEW MARKETS-C (USD)	1720.45	90.19	272619.79	4.97%	1720.45	89.39	269500.32	4.91%
DB X-TRACKER NIFTY 50 UCITS ETF	1000	119.53	233780.36	4.26%	1000	117.19	229203.72	4.18%
DB X-TRACKERS MSCI TAIWAN	3833	19.903	149206.75	2.72%	3833	20.513	153779.73	2.80%
DB X-TRACKERS MSCI EM ASIA	1020	35.54	70900.4	1.29%	1020	36.12	72057.47	1.31%
DB X-TRACKERS MSCI KOREA TRN	1301	52.12	132621.16	2.42%	1301	52.72	134147.88	2.44%
AMUNDI FUNDS THAILAND (USD)	1437.028	134.79	340314.01	6.21%	1437.028	130.09	327595.13	5.97%
FIDELITY FUNDS-INDONESIA FUND A (USD)	1500	27.43	72289.3	1.32%	1500	28.05	73731.39	1.34%

<sup>1</sup> Цена в оригинална валута

ISHARES MSCI BRAZIL	1100	53.35	114777.88	2.09%	1100	54.04	116262.36	2.12%
iSHARES MSCI CANADA B	1307	98.52	251843.7	4.59%	1307	99.34	253939.84	4.63%
ISHARES MSCI AC FAR EAST EX-JAPAN SMALL CAP	1100	24.01	51655.43	0.94%	1100	24.42	52537.51	0.96%
ISHARES JPM EMERG BOND	1200	104.36	244932.5	4.47%	1200	103.14	242069.17	4.41%
ISHARES MSCI EM LATIN AMERICA UCITS ETF	3400	14.048	93416.7	1.70%	3400	13.918	92552.22	1.69%
ISHARES MSCI AC FAR EAST XJP	1720	40.12	134964.79	2.46%	1720	40.82	137319.61	2.50%
ISHARES MSCI TAIWAN	3823	33.47	250259.81	4.56%	3823	33.7	251979.55	4.59%
ISHARES MSCI KOREA	3562	33.01	229969.66	4.19%	3562	33.46	233104.66	4.25%
LYXOR ETF MSCI TAIWAN	5800	10.56	119790.68	2.18%	5800	10.95	124214.76	2.26%
LYXOR BRAZIL (IBOVESPA) UCITS ETF	3000	14.47	84902.58	1.55%	3000	14.56	85430.65	1.56%
LYXOR ETF MSCI MALAYSIA	7994	14.12	220764.86	4.03%	7994	13.83	216230.74	3.94%
LYXOR ETF KOREA	608	46.05	54760.11	1.00%	608	46.74	55580.62	1.01%
LYXOR ETF MSCI INDIA	2480	14.44	70040.62	1.28%	2480	14.24	69070.53	1.26%
LYXOR ETF MSCI AC ASIA PACIFIC EX JAPAN	1524	43.7	130255.93	2.38%	1524	44.63	133027.97	2.42%
ISHARES STOXX EUROPE 600 AUTOMOBILES & PARTS UCITS ETF	1300	46.58	118433.33	2.16%	1300	46.6	118484.18	2.16%
ISHARES NIKKEI 225	5000	14.523	142022.6	2.59%	5000	14.533	142120.39	2.59%
			4 439 736.84	80.95%			4 443 239.83	80.97%

### 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:**

10.10.2016 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.