

ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ НОВИ АКЦИИ”

01.2.2016 г. - 29.2.2016 г.

Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на месец февруари нетните активи на фонда са 7450656.44 лв., което представлява увеличение от 49503.04 лв. спрямо края на месец януари. Броят на емитираните дялове намалява с 32791.2747 и достига 11338022.4405.

Изменение на индексите и разпределение на портфейла по държави

Изменение	Q4 2014	Q1 2015	Q2 2015	Q3 2015	Q4 2015	Февруари 2016
SOFIX	-3.2%	-1.5%	-5.6%	-8.7%	4.03%	-0.15%
CROBEX	-9.0%	-1.9%	1.4%	-3.0%	0.24%	0.13%
BELEX 15	0.9%	-0.1%	-3.1%	-2.7%	2.51%	-2.32%
BET-XT	-1.7%	0.4%	3.1%	-3.3%	0.17%	1.14%
ISE 100	14.4%	-5.7%	1.7%	-7.7%	-5.51%	3.68%
DFNEW	0.262%	-2,04%	-1.7%	-7%	-1.04%	0.95%
Средно аритметично за индексите	-3.2%	-1.75%	-0.48%	-5.1%	0.29%	0.50%
Дял на съответната държава от активите на фонда	31.12.2014	31.03.2015	30.06.2015	30.09.2015	31.12.2015	29.2.2016
България	14.28%	14.87%	14.13%	13.83%	14.07%	13.02%
Хърватска	4.82%	4.31%	4.18%	4.53%	4.70%	4.78%
Сърбия	2.90%	3.10%	3.11%	3.61%	4.11%	4.06%
Румъния	26.65%	25.68%	26.08%	28.83%	28.70%	27.09%
Турция	25.49%	29.07%	29.38%	27.15%	26.67%	29.68%
Словения	7.88%	7.21%	7.64%	10.68%	11.71%	11.61%
Други				3.30%	3.43%	3.59%

Информация за паричните средства

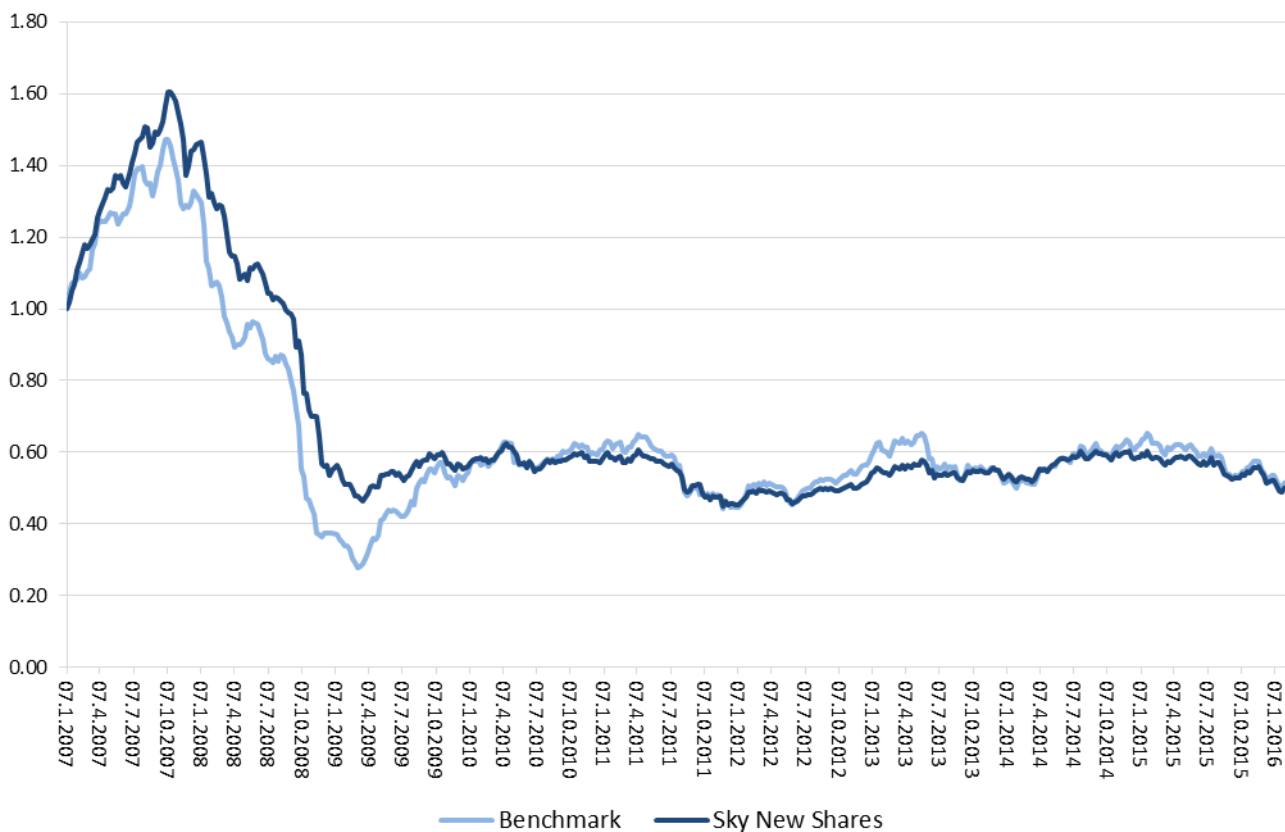
Към 29.2.2016 г. Фонда няма депозити. Паричните средства са по сметки на Фонда в банката-депозитар Юробанк България АД.

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

Индекс	Стандартно отклонение	Изменение 12 месеца	Изменение 24 месеца
SOFIX	10.15%	-8.28%	-24.73%
CROBEX	8.04%	-7.52%	-10.07%
BELEX 15	15.59%	-10.69%	3.46%
BET-XT	14.52%	-10.23%	-1.54%
ISE 100	22.30%	-9.90%	21.20%
Служебен бенчмарк	12.5%	-9.32%	-2.34%
DFNEW	12.31%	-13.16%	-4.14%

Стандартното отклонение е измерено на седмична база за последните 52 седмици. Промяната на индексите е в местна валута.

Движение на цената на фонда спрямо служебния бенчмарк в лева



И през февруари се запазиха големите колебания на пазарите. За разлика от януари обаче колебанията вече не бяха еднопосочно надолу. Всички основни негативни трендове от последните месеци – и при банките и при развиващите се пазари и в цената на петрола и на ресурсите намериха някаква опора. Получи се движение в широк диапазон, с постепенно заглъхваща амплитуда, което обикновено е характерно за нервни пазари, които изчакват важни новини.

През март предстоят важни икономически събития – решението на ЕЦБ и на ФЕД за лихвените проценти и на ЕЦБ за количествените улеснения. Тъй като, това по принцип са новини, предизвикващи значителни по-сила тенденции, е нормално и пазарите да са изнервени преди тях. Фундаментално повечето пазари изглеждат значително по-евтини спрямо последните месеци и дори години. Липсват и значителни негативни фактори, които да доведат до трайно влошаване на икономическата среда. Всичко това говори, че песимизмът на пазарите е по-скоро въпрос на настроения и емоции, а не толкова плод на реални опасения за навлизане на икономиките в спирала на лоши новини. От тази гледна точка разглеждаме последните действия по-скоро като част от дълбока корекция на дългосрочния възходящ тренд – следващ възстановяването на световната икономика – отколкото като започване на мечи тренд.

Представяне на фонда за последната година - по месеци

Доходност по месеци	Средно аритметично за индексите	DFNEW
Февруари 2015	-1.63%	-1.19%
Март 2015	-0.10%	-1.04%
Април 2015	2.93%	1.91%
Май 2015	-1.18%	-0.90%
Юни 2015	-2.09%	-2.68%
Юли 2015	0.88%	0.88%
Август 2015	-4.39%	-5.97%
Септември 2015	-1.55%	-1.93%
Октомври 2015	1.76%	3.30%
Ноември 2015	-2.34%	-0.28%
Декември 2015	0.97%	-3.93%
Януари 2016	-4.39%	-3.93%
Февруари 2016	0.50%	0.95%

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

Активи	30.11.2015	31.12.2015	31.1.2016	29.2.2016	Структура на активите спрямо общата им стойност [%]
Акции и права и КИС	7 498 328	7 527 078	6 933 670	7 010 296	93.82%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	537 997	518 300	487 687	459 744	6.15%
Депозити до 3 мес.	0	0	0	0	0.00%
Вземания	47 414	0	0	9	0.00%
Разходи за бъдещи периоди	345	176	1 876	1 714	0.02%
Общо:	8 084 084	8 045 554	7 423 233	7 471 762	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “СКАЙ Нови Акции” акции

Дружество	31.1.2016			29.2.2016			
	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							
София Комерс - заложни къщи АД	4812	4.49	21606	4812	4.29	20643	0.28%
Софарма АД - София	81992	2.64	216131	81992	2.63	215475	2.88%
М и С ХИДРАВЛИК АД	11490	4.99	57289	11490	4.96	56933	0.76%
ЗЪРНЕНИ ХРАНИ БЪЛГАРИЯ АД	9766	0.33	3233	9766	0.31	3057	0.04%
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	282929	0.32	90537	282929	0.01	3112	0.04%
Монбат АД	20000	7.35	147000	20000	7.28	145520	1.95%
Албена инвест холдинг	5317	6.01	31960	5317	6.08	32333	0.43%
Химимпорт АД	42568	1.31	55594	42568	1.25	53338	0.71%

¹ Цени в съответната валута

СИРМА ГРУП ХОЛДИНГ АД	33333	1.16	38800	33333	1.16	38666	0.52%
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.00	149	149450	0.00	149	0.00%
ЧЕЗ РАЗПРЕДЕЛЕНИЕ БЪЛГАРИЯ АД	600	131.00	78600	600	138.00	82800	1.11%
Индустриален Холдинг България АД	23333	0.86	20066	23333	0.81	18900	0.25%
ИД Елана високодоходен фонд	3316	90.33	299539	3316	91.13	302177	4.04%
Общо:			1060504			973103	13.02%
АКЦИИ ХЪРВАТСКА							
KONCHAR ELECTROINDUSTRIJA D.D.	844	647.99	139641	844	635.05	137457	1.84%
KONCHAR TRANSFORMATORI	412	1260.00	132547	412	1320.00	139473	1.87%
Duro Dakovic holding	1000	33.11	8454	1000	37.90	9720	0.13%
Atlanska Plovitba D.D. DUBROVNIK	730	117.79	21955	730	99.53	18634	0.25%
Adris P-A	560	345.00	49330	560	359.28	51599	0.69%
Общо:			351927			356882	4.78%
АКЦИИ РУМЪНИЯ							
CNTEE TRANSELECTRICA SA	29275	27.60	348451	29275	29.05	371632	4.97%
TRANSGAZ SA MEDIAS	900	260.00	100914	900	258.00	101469	1.36%
Petrom Bucuresti	3000000	0.25	320854	3000000	0.24	310044	4.15%
S.N.G.N. ROMGAZ S.A.	5000	23.70	51104	5000	26.60	58120	0.78%
SIF OLTENIA CRAIOVA	335000	1.56	225374	335000	1.52	222222	2.97%
SIF Transilvania /SIF 3/	400000	0.27	46834	400000	0.27	46758	0.63%
SIF MOLDOVA BACAU	468000	0.70	141481	468000	0.70	143158	1.92%
SIF Banat Crisana /SIF 1/	250000	1.54	165818	250000	1.49	162560	2.18%
SNO - Santierul Naval Orsova	17700	2.45	18701	17700	2.39	18486	0.25%

Farmaceutica Remedia SA	104000	0.20	9060	104000	0.20	9089	0.12%
SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/	1466649	0.73	461726	1466649	0.74	474273	6.35%
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	24420	10.04	105734	24420	9.93	105966	1.42%
ОБЩО			1996052			2023776	27.09%
АКЦИИ СЪРБИЯ							
Veterinarski zavod AD	3017	430.00	20587	3017	400.00	19112	0.26%
Novosadski sajam a.d. Novi Sad	1745	550.00	15230	1745	550.00	15199	0.20%
NIS AD NOVI SAD	3881	561.00	34551	3881	539.00	33128	0.44%
RTC LUKA LEGET A.D.	223	3098.39	10965	223	3098.39	10942	0.15%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	210	1570.00	5232	210	1499.00	4985	0.07%
ALFA PLAM a.d. Vranje	266	31741.00	133984	266	33500.00	141120	1.89%
AIK BANKA a.d. Niš	2774	1830.00	80558	2774	1800.00	79075	1.06%
Agrobanka a.d. Beograd	132	0.01	0	132	0.01	0	0.00%
Общо			301106			303562	4.06%
АКЦИИ ТУРЦИЯ							
TURK TRAKTOR	6500	72.55	284975	6500	78.65	309816	4.15%
TAV HAVALIMANLARI	33000	17.50	348986	33000	17.45	348981	4.67%
MIGROS	6000	15.97	57904	6000	15.25	55451	0.74%
Enka Insaat Ve Sanayi AS	24885	4.39	66017	24885	4.78	72087	0.96%
YAPI VE KREDI BANKASI	63000	3.71	141244	63000	3.75	143174	1.92%
Turkcell	15000	10.52	95359	15000	11.08	100722	1.35%
Haci Omer Sabanci Holding	16888	8.55	87257	16888	8.72	89246	1.19%
KOC HOLDING	34755	11.82	248251	34755	12.94	272548	3.65%
İŞ BANKASI (C)	33800	4.62	94366	33800	4.52	92586	1.24%

T. GARANTI BANKASI	42500	7.43	190824	42500	7.36	189565	2.54%
EREĞLİ DEMİR ÇELİK /EREGL	62000	3.09	115773	62000	3.45	129629	1.73%
Arcelik /ARCLK.E	21000	15.41	195559	21000	19.11	243205	3.25%
ADANA CIMENTO C	219360	0.62	82187	219360	0.66	87739	1.17%
ADANA CIMENTO A	21000	5.88	74619	21000	6.49	82595	1.11%
Общо			2083320			2217345	29.68%
KRKA DD	5475	62.00	663906	5475	61.49	658445	8.81%
ZAVAROVALNICA TRIGLAV	4483	24.00	210432	4483	23.80	208678	2.79%
Общо			874338			867123	11.61%
ISHARES JPM EMERG BOND	1400	97.30	266423	1400	98.06	268504	3.59%
Общо:			6933670			7010296	93.82%

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:

10.3.2016 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.