

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

01.7.2016 г. - 31.7.2016 г.

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

Към края на месец юли нетните активи на фонда са 5 483 123.02 лв., което представлява увеличение от 222 348.20 лв. спрямо края на месец юни. 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	2.7%	4.2%	-6.1%	-14.4%	6.3%	2.5%	6.0%
Индия	4.8%	11.0%	2.7%	-5.5%	14.9%	4.7%	6.9%
Индонезия	5.1%	13.0%	17.1%	14.0%	2.8%	0.4%	10.3%
Корея	5.4%	7.7%	6.6%	8.5%	6.5%	2.3%	3.9%
Малайзия	-1.5%	-2.8%	1.1%	-10.4%	-5.0%	-1.1%	5.6%
Филипини	1.4%	14.1%	11.3%	2.0%	10.5%	16.3%	13.3%
Тайван	4.9%	13.6%	9.9%	0.4%	9.2%	5.3%	4.0%
Тайланд	6.5%	12.0%	22.9%	3.6%	3.1%	4.7%	8.8%
Бразилия	9.1%	15.7%	54.0%	12.6%	-3.4%	-9.5%	0.2%
Чили	2.3%	3.7%	13.0%	3.4%	-2.7%	-6.7%	3.8%
Колумбия	-6.6%	-7.1%	13.9%	-11.6%	-17.8%	-9.6%	3.0%
Мексико	-1.1%	-5.3%	-3.1%	-12.9%	-2.7%	1.2%	3.4%
Перу	4.9%	12.5%	52.3%	21.7%	13.0%	2.9%	9.7%
Латинска Америка	4.7%	6.9%	27.0%	2.5%	-3.4%	-6.5%	1.2%
Чехия	7.5%	-1.6%	-1.3%	-19.6%	-1.8%	-9.9%	-4.1%
Унгария	7.4%	-0.1%	14.8%	19.9%	6.6%	-2.1%	-3.0%
Полша	1.5%	-7.0%	-7.6%	-25.3%	-9.2%	-9.3%	-6.2%
Русия	-1.1%	-2.3%	15.6%	0.7%	-7.3%	-9.7%	-6.7%
Турция	-6.4%	-15.4%	0.3%	-13.2%	-7.2%	-2.5%	0.7%
Египет	20.0%	10.2%	9.8%	-7.0%	15.2%	9.4%	2.3%
Южна Африка	8.1%	8.5%	20.7%	-6.3%	5.7%	1.9%	4.1%
Развиваща се Азия	3.9%	7.7%	2.5%	-4.2%	6.7%	3.0%	4.9%
Развиващи се пазари	4.0%	6.5%	6.9%	-4.3%	3.1%	-0.3%	2.8%

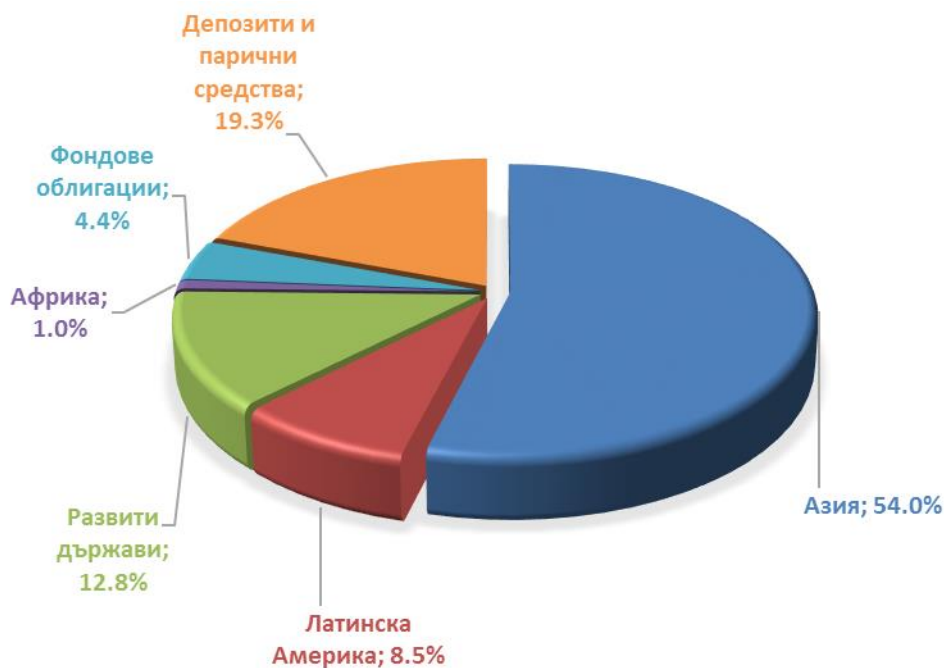
Към 31.7.2016 г.

През юли продължи позитивния тренд на пазарите. Очакванията за вдигането на лихвените проценти в САЩ бяха ревизирани надолу, което даде тласък на пазарите, както на развитите, така и на развиващите се. Същевременно отчетите за второто тримесечие на компаниите в общи линии се оказаха по-позитивни от очакванията, което също допринесе за позитивната инерция.

Едно изключение бе Турция, където опитът за преврат създаде значителни флукуации на пазара. Въпреки доста агресивната риторика на Ердоган, не очакваме, че това ще създаде трайно негативен тренд на турския пазар. За добро или за лошо турския пазар е до известна степен привикнал на политическа нестабилност и въпреки високата си волатилност е до голяма степен фокусиран по-скоро върху икономическия фундамент, отколкото върху политиката. Ако превратът бе успял обаче щеше да съществува сериозен натиск надолу, дори само заради несигурността свързана с бъдещата

икономическа политика в страната. Към момента основния тренд в Турция се дължи в много по-висока степен на глобалната икономическа ситуация отколкото на действията на Ердоган.

#### Разпределение на активите на фонда по региони



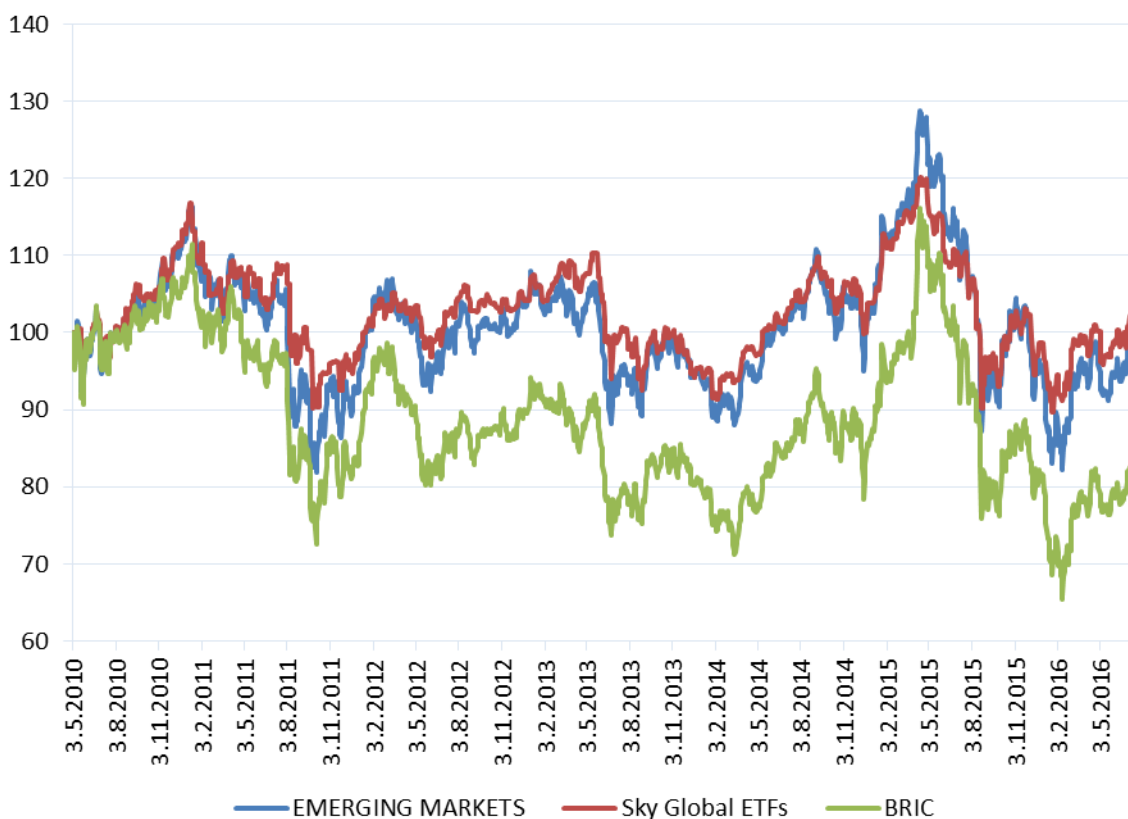
#### Стойност на портфейла в началото и в края на отчетния период в лева

Активи	31.05.2016	30.06.2016	31.07.2016	Структура на активите спрямо общата им стойност %/
Дялове в КИС, акции и права	4 067 599	4 216 330	4 407 405	80.7%
Облигации	0	0	0	0.0%
Парични средства	1 056 711	1 052 307	1 051 372	19.25%
Депозити до 3 мес.	0	0	0	0.00%
Вземания	2 981	0	1 052	0.0%
Други	1 199	1 031	857	0.02%
<b>Общо:</b>	<b>5 128 490</b>	<b>5 269 668</b>	<b>5 460 685</b>	<b>100.0%</b>

### Информация за паричните средства

Към 31.7.2016 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

	Q4 2014	Q1 2015	Q2 2015	Q3 2015	Q4 2015	Q1 2016	Q2 2016	Юли 2016
Доходност MSCI EM	-0.7%	14.8%	-3.8%	-18.7%	3.03%	0.45%	2.24%	4.03%
Доходност ДФ Скай Глобал ETFs	-2%	10.23%	-5.4%	-13.6%	4.44%	0.92%	1.88%	4.2%
Стандартно отклонение на ДФ Скай Глобал ETFs	17.60%							

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

Company	30.6.2016				31.7.2016			
	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	8.338	48923.13	0.93%	3000	8.938	52443.63	0.96%
DB X-TRACKERS MSCI SINGAPORE	53000	1.03	106768.76	2.03%	53000	1.03	106768.76	1.96%
DB X-TRACKERS MSCI PHILIPPINES IM TRN INDEX UCITS ETF	25600	1.928	96533.51	1.83%	25600	1.949	97584.96	1.79%
MULTI UNITS LUXEMBOURG-LYXOR ETF AUSTRALIA (S&P ASX	2500	37.64	184043.6	3.49%	2500	39.61	193676.07	3.55%
DB X-TRACKERS MSCI INDONESIA TRN INDEX ETF	5499	12.11	130244.37	2.47%	5499	12.83	137988.05	2.53%
DB X-TRACKERS MSCI MEXICO	21565	4.165	175669.18	3.33%	21565	4.107	173222.89	3.17%
DB X-TRACKERS FTSE VIETNAM ETF	845	21.28	35168.95	0.67%	845	21.94	36259.72	0.66%
DB X-TRACKERS MSCI AC ASIA X-JP	1100	29.21	62842.77	1.19%	1100	30.57	65768.7	1.20%
AMUNDI FUNDS ASEAN NEW MARKETS-C (USD)	1720.45	86.21	261293.85	4.96%	1720.45	90.3	273419.91	5.01%
DB X-TRACKER NIFTY 50 UCITS ETF	1000	112.29	219620.15	4.17%	1000	118.35	231472.48	4.24%
DB X-TRACKERS MSCI TAIWAN	3833	18.52	138838.82	2.63%	3833	19.76	148134.72	2.71%
DB X-TRACKERS MSCI EM ASIA	1020	33.1	66032.73	1.25%	1020	34.57	68965.3	1.26%
DB X-TRACKERS MSCI KOREA TRN	1301	47.98	122086.78	2.32%	1301	51.13	130102.07	2.38%
AMUNDI FUNDS THAILAND (USD)	1437.028	123.61	312930.81	5.94%	1437.028	132.34	334700.75	6.13%

<sup>1</sup> Цена в оригинална валута

FIDELITY FUNDS-INDONESIA FUND A (USD)	1500	25.9	68441.66	1.30%	1500	27.24	71911.56	1.32%
ISHARES MSCI BRAZIL	1100	48.42	104171.42	1.98%	1100	52.91	113831.26	2.08%
iSHARES MSCI CANADA B	1307	95.47	244047.08	4.63%	1307	97.96	250412.19	4.59%
ISHARES MSCI AC FAR EAST EX-JAPAN SMALL CAP	1100	22.97	49417.96	0.94%	1100	23.78	51160.6	0.94%
ISHARES JPM EMERG BOND	1200	102.1	239628.29	4.55%	1200	102.59	240778.32	4.41%
ISHARES MSCI EM LATIN AMERICA UCITS ETF	3400	13.21	87844.15	1.67%	3400	13.89	92366.03	1.69%
ISHARES MSCI AC FAR EAST XJP	1720	37.44	125949.19	2.39%	1720	39.05	131365.28	2.41%
ISHARES MSCI TAIWAN	3823	31.29	233959.65	4.44%	3823	33.29	248913.93	4.56%
ISHARES MSCI KOREA	3562	30.32	211229.33	4.01%	3562	32.37	225510.99	4.13%
LYXOR ETF MSCI TAIWAN	5800	9.868	111940.76	2.12%	5800	10.5	119110.05	2.18%
LYXOR BRAZIL (IBOVESPA) UCITS ETF	3000	13.03	76453.39	1.45%	3000	14.22	83435.71	1.53%
LYXOR ETF MSCI MALAYSIA	7994	14.27	223110.09	4.23%	7994	14.04	219514.07	4.02%
LYXOR ETF KOREA	608	42.35	50360.28	0.96%	608	45.21	53761.23	0.98%
LYXOR ETF MSCI INDIA	2480	13.63	66111.75	1.25%	2480	14.42	69943.61	1.28%
LYXOR ETF MSCI AC ASIA PACIFIC EX JAPAN	1524	40.95	122059.05	2.32%	1524	43.08	128407.91	2.35%
ISHARES STOXX EUROPE 600 AUTOMOBILES & PARTS UCITS ETF	1300	41.92	106584.91	2.02%	1300	46.16	117365.45	2.15%
ISHARES NIKKEI 225	5000	13.705	134023.25	2.54%	5000	14.225	139108.41	2.55%
			4 216 329.62	80.01%			4 407 404.61	80.71%

### 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:**

10.8.2016 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.