

ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ НОВИ АКЦИИ”

01.6.2017 г. - 30.6.2017 г.

Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на месец юни нетните активи на фонда са 8 638 599.120 лв., което представлява увеличение от 44 012.69 лв. спрямо края на месец май. Броят на емитираните дялове се увеличават до 11 254 699.1112.

Изменение на индексите в местна валута и разпределение на портфейла по държави

| Изменение | Q2 2016 | Q3 2016 | Q4 2016 | Q1 2017 | Q2 2017 | Юни 2017 |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|----------|
| SOFIX | 2.06% | 10.8% | 16.22% | 8.1% | 11.0% | 6.39% |
| CROBEX | 0.38% | 15.8% | 2.76% | -0.3% | -6.2% | 0.08% |
| BELEX 15 | -0.23% | 5.2% | 12.74% | 2.1% | -2.9% | -2.00% |
| BET-XT | -4.07% | 7.1% | 2.50% | 13.0% | -1.6% | -9.12% |
| ISE 100 | -7.75% | -0.4% | 2.16% | 13.8% | 12.9% | 2.97% |
| DFNEW | -3.82% | 5.17% | -2.50% | 7.41% | 4.82% | 0.52% |
| Средно аритметично за индексите | -1.92% | 7.7% | 7.27% | 7.35% | 2.63% | -0.34% |
| Дял на съответната държава от активите на фонда | 30.06.2016 | 30.09.2016 | 31.12.2016 | 31.3.2017 | 30.6.2017 | |
| България | 14.12% | 16.44% | 16.14% | 16.92% | 16.58% | |
| Хърватска | 4.91% | 5.15% | 5.78% | 6.06% | 5.72% | |
| Сърбия | 4.09% | 2.92% | 3.00% | 2.84% | 3.36% | |
| Румъния | 26.19% | 27.15% | 28.08% | 29.07% | 26.73% | |
| Турция | 28.97% | 26.70% | 25.85% | 25.43% | 28.47% | |
| Словения | 10.73% | 10.87% | 9.98% | 9.50% | 9.33% | |
| Други | 3.71% | 3.57% | 3.69% | 3.47% | 3.13% | |

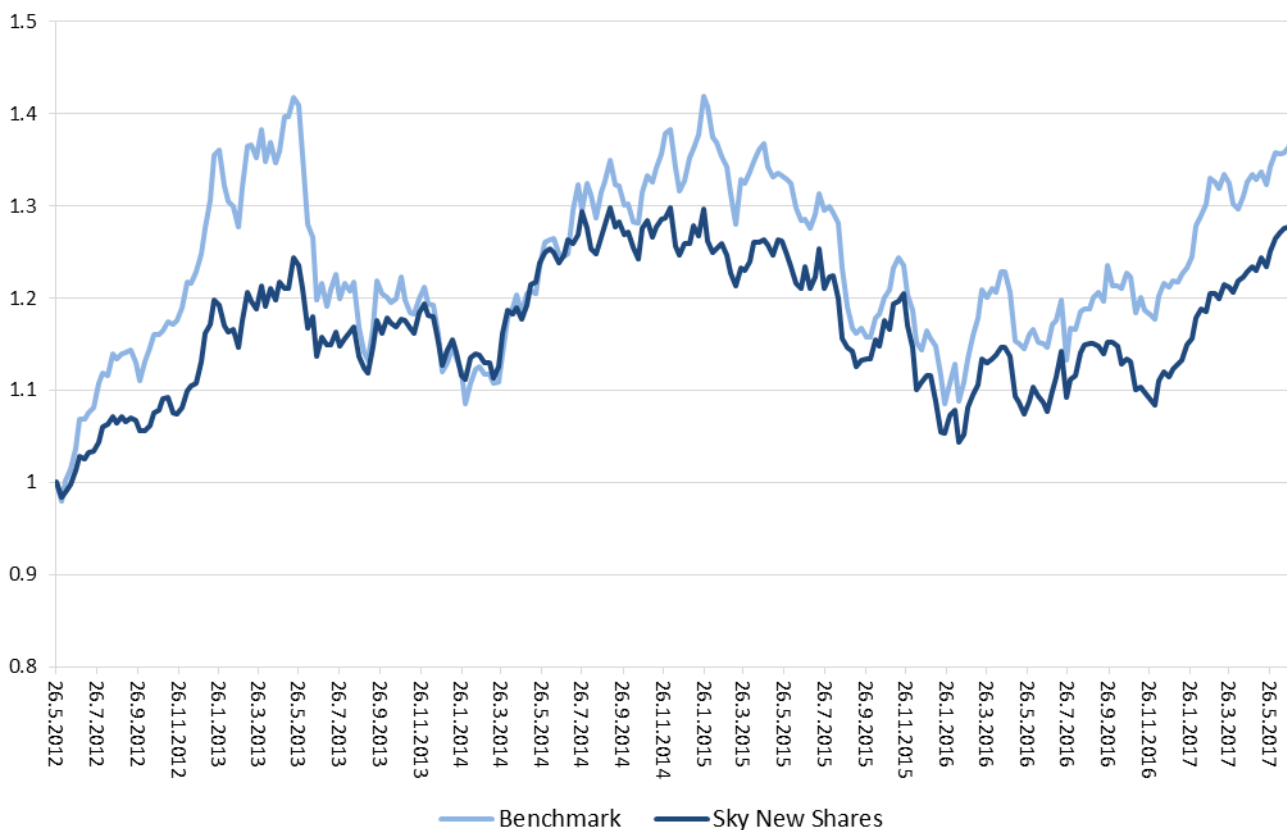
Информация за паричните средства

Към 30.6.2017 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 | 9.56% | 54.42% | 44.97% |
| CROBEX | 11.50% | 11.31% | 7.37% |
| BELEX 15 | 10.23% | 17.63% | 10.15% |
| BET-XT | 9.52% | 21.98% | 8.23% |
| ISE 100 | 21.49% | 30.75% | 22.12% |
| Служебен бенчмарк | 11.83% | 27.22% | 18.57% |
| DFNEW | 8.81% | 15.45% | 4.31% |

Стандартното отклонение е измерено на седмична база за последните 52 седмици. Промяната на индексите е в местна валута. До голяма степен именно поради значителния спад на някои валути към еврото се дължи и голямото разминаване между представянето на фонда и индексите, измерени в местна валута. На долната графика това изменение на валутите е изчистено, като служебния бенчмарк е представен в лева.

Движение на цената на фонда спрямо служебния бенчмарк в лева за последните 5 години


Служебният бенчмарк представлява промяната във възвращаемостта на индексите ISE 100, SOFIX, BET-XT и CROBEX взети с равно тегло.

И през юни продължи периода на ниска волатилност на финансовите пазари. Индексите на развитите пазари не отбелязаха съществени изменения, в която и да било посока вече за трети месец. При развиващите се пазари има малко повече динамика, но почти единствено в посока надолу. При тях въздействат по-скоро локални фактори като обвиненията в корупция в Бразилия, цената на петрола за Русия или законодателни промени в Румъния.

Погледнато в перспектива, остават големите неизвестни какво ще се случи след прекратяване или дори само при намаляване на паричните стимули в Еврозоната, вдигането на лихвите в САЩ или пък евентуален скок на инфлацията. Възможните глобални катализатори обаче набъбнаха с още един – възможността на Северна Корея да изстрелва междуконтинентални балистични ракети. Това до голяма степен променя ситуацията, като значително повишава вероятността за военен отговор от страна на САЩ и дори за пълномащабна война между Северна и Южна Корея. В чисто икономически план, ако се стигне до подобно неприятно решение, е доста възможно обтягане на отношенията между САЩ и Китай и от тук до глобални последиствия за световната икономика.

Представяне на фонда за последната година - по месеци

| Доходност по месеци | Средно аритметично за индексите | DFNEW |
|---------------------|---------------------------------|--------|
| Юни 2016 | 0.28% | 0.51% |
| Юли 2016 | 2.67% | 1.46% |
| Август 2016 | 1.55% | 3.22% |
| Септември 2016 | 3.28% | 0.43% |
| Октомври 2016 | 2.74% | -1.70% |
| Ноември 2016 | 1.01% | -3.77% |
| Декември 2016 | 3.35% | 3.07% |
| Януари 2017 | 4.59% | 4.02% |
| Февруари 2017 | 3.07% | 2.64% |
| Март 2017 | -0.32% | 0.60% |
| Април 2017 | 1.10% | 2.31% |
| Май 2017 | 1.82% | 1.92% |
| Юни 2017 | -0.34% | 0.52% |

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

| Активи | 31.3.2017 | 30.4.2017 | 31.5.2017 | 30.6.2017 | Структура на активите спрямо общата им стойност /%/ |
|---------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|---|
| Акции и права и КИС | 7 722 546 | 7 881 698 | 8 235 752 | 8 082 546 | 93.31% |
| Облигации | - | - | - | - | |
| Парични средства | 552 780 | 578 276 | 352 002 | 546 036 | 6.30% |
| Депозити до 3 мес. | 0 | 0 | 0 | 0 | 0.00% |
| Вземания | 1 230 | 8 151 | 27 262 | 32 205 | 0.37% |
| Разходи за бъдещи периоди | 1 545 | 1 377 | 1 203 | 1 035 | 0.01% |
| Общо: | 8 278 101 | 8 469 502 | 8 616 219 | 8 661 822 | 100.00% |

Стойност на притежаваните от ДФ “СКАЙ Нови Акции” акции

| Дружество | 31.5.2017 | | | 30.6.2017 | | | |
|-------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------|---------------------|
| | 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 | | | | | | | |
| ИД Елана високодоходен фонд | 3316 | 107.91 | 357816 | 3316 | 107.20 | 355460 | 4.10% |
| Софарма АД - София | 85035 | 4.03 | 342606 | 85035 | 4.50 | 382743 | 4.42% |
| М и С ХИДРАВЛИК АД | 11490 | 7.69 | 88404 | | | | |
| Албена АД | 1213 | 61.46 | 74551 | 1213 | 64.58 | 78339 | 0.90% |
| ЗЪРНЕНИ ХРАНИ БЪЛГАРИЯ АД | 9766 | 0.36 | 3526 | 9766 | 0.38 | 3750 | 0.04% |
| ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ | 130000 | 0.28 | 36010 | 110275 | 0.47 | 51829 | 0.60% |
| Монбат АД | 20000 | 10.97 | 219440 | 20000 | 11.84 | 236800 | 2.73% |
| София Комерс - заложни къщи 2 | 4812 | 3.89 | 18704 | 4812 | 3.77 | 18141 | 0.21% |
| Химимпорт АД | 62578 | 1.72 | 107446 | 62578 | 1.77 | 111013 | 1.28% |

¹ Цени в съответната валута

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|---------|---------|---------|---------|--------|
| ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ | 149450 | 0.00 | 149 | 149450 | 0.00 | 149 | 0.00% |
| ЧЕЗ РАЗПРЕДЕЛЕНИЕ БЪЛГАРИЯ АД | 572 | 268.17 | 153394 | 572 | 261.12 | 149360 | 1.72% |
| Индустриален Холдинг България АД | 48333 | 0.95 | 45820 | 48333 | 1.00 | 48526 | 0.56% |
| Общо: | | | 1447867 | | | 1436111 | 16.58% |
| АКЦИИ ХЪРВАТСКА | | | | | | | |
| KONCHAR ELECTROINDUSTRIJA D.D. | 844 | 760.00 | 169225 | 844 | 730.02 | 162619 | 1.88% |
| KONCHAR TRANSFORMATORI | 412 | 1611.00 | 175106 | 412 | 1648.00 | 179205 | 2.07% |
| Duro Dakovic holding | 1000 | 36.90 | 9735 | 1000 | 34.06 | 8990 | 0.10% |
| Atlanska Plovitba D.D. DUBROVNIK | 730 | 390.00 | 75110 | 730 | 395.01 | 76107 | 0.88% |
| Adris P-A | 560 | 470.00 | 69437 | 560 | 463.00 | 68433 | 0.79% |
| Общо: | | | 498612 | | | 495354 | 5.72% |
| АКЦИИ РУМЪНИЯ | | | | | | | |
| CNTEE TRANSELECTRICA SA | 29275 | 33.20 | 416368 | 29275 | 27.35 | 343997 | 3.97% |
| TRANSGAZ SA MEDIAS | 900 | 449.00 | 173114 | 900 | 358.00 | 138429 | 1.60% |
| Petrom Bucuresti | 3000000 | 0.33 | 423466 | 3000000 | 0.28 | 365405 | 4.22% |
| S.N.G.N. ROMGAZ S.A. | 5000 | 33.90 | 72613 | 5000 | 30.75 | 66057 | 0.76% |
| SIF OLTENIA CRAIOVA | 335000 | 1.78 | 254877 | 335000 | 1.77 | 255041 | 2.94% |
| SIF Transilvania /SIF 3/ | 400000 | 0.25 | 42668 | 400000 | 0.25 | 42792 | 0.49% |
| SIF MOLDOVA BACAU | 468000 | 0.94 | 188659 | 468000 | 0.97 | 194434 | 2.24% |
| SIF Banat Crisana /SIF 1/ | 250000 | 1.95 | 209270 | 250000 | 1.94 | 208373 | 2.41% |
| SNO - Santierul Naval Orsova | 17700 | 2.98 | 22596 | 17700 | 2.98 | 22662 | 0.26% |
| Farmaceutica Remedia SA | 104000 | 0.23 | 10292 | 104000 | 0.30 | 13405 | 0.15% |
| SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/ | 1466649 | 0.91 | 573012 | 1466649 | 0.83 | 523004 | 6.04% |

| | | | | | | | |
|---------------------------------------|-------|----------|---------|-------|----------|---------|--------|
| BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti | 24420 | 12.98 | 135788 | 24420 | 13.48 | 141428 | 1.63% |
| ОБЩО | | | 2522722 | | | 2315026 | 26.73% |
| АКЦИИ СЪРБИЯ | | | | | | | |
| Veterinarski zavod AD | 3017 | 175.00 | 8419 | 3017 | 150.00 | 7324 | 0.08% |
| Novosadski sajam a.d. Novi Sad | 1745 | 750.00 | 20868 | 1745 | 2578.71 | 72826 | 0.84% |
| NIS AD NOVI SAD | 3881 | 737.00 | 45607 | 3881 | 676.00 | 42460 | 0.49% |
| RTC LUKA LEGET A.D. | 223 | 3120.74 | 11096 | 223 | 3120.74 | 11263 | 0.13% |
| KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD | 210 | 1823.00 | 6104 | 210 | 1800.00 | 6118 | 0.07% |
| ALFA PLAM a.d. Vranje | 266 | 35500.00 | 150568 | 266 | 35000.00 | 150674 | 1.74% |
| Agrobanka a.d. Beograd | 132 | 0.01 | 0 | 132 | 0.01 | 0 | 0.00% |
| Общо | | | 242662 | | | 290665 | 3.36% |
| АКЦИИ ТУРЦИЯ | | | | | | | |
| TURK TRAKTOR | 6500 | 81.85 | 262209 | 6500 | 78.95 | 250083 | 2.89% |
| TAV HAVALIMANLARI | 33000 | 17.29 | 281206 | 33000 | 18.87 | 303462 | 3.50% |
| MIGROS | 6000 | 26.96 | 79724 | 6000 | 27.56 | 80584 | 0.93% |
| Enka Insaat Ve Sanayi AS | 28619 | 5.36 | 75601 | 28619 | 5.37 | 74893 | 0.86% |
| YAPI VE KREDI BANKASI | 63000 | 4.40 | 136618 | 63000 | 4.49 | 137850 | 1.59% |
| TRAKYA CAM SANAYI A.S | 55000 | 3.95 | 107072 | 55000 | 3.87 | 103727 | 1.20% |
| Turkcell | 15000 | 12.16 | 89896 | 15000 | 11.58 | 84648 | 0.98% |
| TURKIYE SISE VE CAM FABRIKALARI A.S. | 43000 | 4.71 | 99817 | 43000 | 4.60 | 96393 | 1.11% |
| Haci Omer Sabanci Holding | 16888 | 10.70 | 89059 | 16888 | 10.93 | 89953 | 1.04% |
| KOC HOLDING | 34755 | 16.04 | 274750 | 34755 | 16.18 | 274040 | 3.16% |
| İŞ BANKASI (C) | 33800 | 7.01 | 116775 | 33800 | 7.45 | 122713 | 1.42% |
| T. GARANTI BANKASI | 42500 | 9.60 | 201083 | 42500 | 9.79 | 202764 | 2.34% |

| | | | | | | | |
|---------------------------|--------|--------|---------|--------|-------|---------|--------|
| EREĞLİ DEMİR CELİK /EREGL | 62000 | 6.39 | 195258 | 62000 | 7.05 | 213010 | 2.46% |
| Arcelik /ARCLK.E | 21000 | 24.42 | 252744 | 21000 | 26.06 | 266693 | 3.08% |
| ADANA CIMENTO C | 219360 | 0.86 | 92976 | 219360 | 0.87 | 93003 | 1.07% |
| ADANA CIMENTO A | 21000 | 7.05 | 72967 | 21000 | 7.08 | 72455 | 0.84% |
| Общо | | | 2427754 | | | 2466272 | 28.47% |
| АКЦИИ СЛОВЕНИЯ | | | | | | | |
| KRKA DD | 5475 | 54.00 | 578241 | 5475 | 55.00 | 588949 | 6.80% |
| ZAVAROVALNICA TRIGLAV | 4483 | 27.45 | 240681 | 4483 | 25.00 | 219200 | 2.53% |
| Общо | | | 818922 | | | 808149 | 9.33% |
| ISHARES JPM EMERG BOND | 1400 | 101.24 | 277212 | 1400 | 98.96 | 270969 | 3.13% |
| Общо: | | | 8235752 | | | 8082546 | 93.31% |

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:

07.7.2017 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 организирания 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.