

ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ НОВИ АКЦИИ”

01.10.2016 г. - 31.10.2016 г.

Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на месец октомври нетните активи на фонда са 7 753 046.49 лв., което представлява намаление от -140 582.40 лв. спрямо края на месец септември. Броят на емитираните дялове намалява с -9 770.3888 и достига 11 278 114.8193.

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

Изменение	Q3 2015	Q4 2015	Q1 2016	Q2 2016	Q3 2016	Октомври 2016
SOFIX	4.03%	-3.2%	-0.24%	2.06%	10.8%	5.40%
CROBEX	0.24%	-1.2%	3.43%	0.38%	15.8%	0.91%
BELEX 15	2.51%	-5.9%	3.13%	-0.23%	5.2%	6.49%
BET-XT	0.17%	-4.5%	4.81%	-4.07%	7.1%	-1.78%
ISE 100	-5.51%	16.1%	9.83%	-7.75%	-0.4%	2.68%
DFNEW	-1.04%	2.04%	5.20%	-3.82%	5.17%	-1.70%
Средно аритметично за индексите	0.29%	0.3%	4.19%	-1.92%	7.7%	2.74%
Дял на съответната държава от активите на фонда	30.09.2015	31.12.2015	31.03.2016	30.06.2016	30.09.2016	31.10.2016
България	13.83%	14.07%	13.41%	14.12%	16.44%	15.87%
Хърватска	4.53%	4.70%	4.73%	4.91%	5.15%	5.81%
Сърбия	3.61%	4.11%	4.18%	4.09%	2.92%	2.90%
Румъния	28.83%	28.70%	26.64%	26.19%	27.15%	26.86%
Турция	27.15%	26.67%	30.64%	28.97%	26.70%	27.30%
Словения	10.68%	11.71%	11.42%	10.73%	10.87%	10.66%
Други	3.30%	3.43%	3.37%	3.71%	3.57%	3.66%

Информация за паричните средства

Към 31.10.2016 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	8.75%	19.00%	2.21%
CROBEX	8.89%	13.56%	6.54%
BELEX 15	14.15%	9.61%	-3.50%
BET-XT	13.23%	-5.97%	-2.80%
ISE 100	25.31%	-1.10%	-2.54%
Служебен бенчмарк	14.76%	7.02%	-0.02%
DFNEW	12.54%	-2.80%	-11.83%

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


Основната тема на пазарите през октомври бяха президентските избори в САЩ. До известна степен съществува амбивалентност и към двата основни кандидата. Заявените от Доналд Тръмп мерки ограничаващи емиграцията и наказателни мита срещу Китай, биха се отразили зле на развиващите се пазари. А желанието му за увеличаващи се дефицити и намаляване на данъците, биха създали инфлационен натиск в САЩ, а и в света, но същевременно биха стимулирали местното производство в САЩ, особено що се отнася до инфраструктура. Заявеното от него намаляване на регулациите със сигурност среща позитивна нагласа в силно регулираните отрасли, като петролната промишленост, минната и до някъде финансовата сфера. Опасността при избор на Тръмп е, че огласените от него намерения е просто невъзможно да бъдат приложени в цялост, без натрупването на огромен нов държавен дълг. В същото време рязкото преминаване от една икономическа политика към друга, неизбежно би довела до сътресения на един или друг пазар.

Клинтън, от друга страна, олицетворява естествено продължение на една успешна политика – тази на Обама. Запазване на статуквото и липса на изненади – което обикновено се приема позитивно от пазарите. От друга страна желанието и да повиши държавната намеса в някои сектори – като фармацевтията и финансовия сектор, оказва сериозен натиск върху възможностите за растеж там.

Представяне на фонда за последната година - по месеци

Доходност по месеци	Средно аритметично за индексите	DFNEW
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%
Март 2016	4.19%	5.20%
Април 2016	-0.04%	-0.22%
Май 2016	-2.10%	-4.10%
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%

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

Активи	31.7.2016	31.8.2016	30.9.2016	31.10.2016	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права и КИС	6 993 571	7 256 935	7 344 025	7 235 694	93.07%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	597 927	616 293	548 854	538 471	6.93%
Депозити до 3 мес.	0	0	0	0	0.00%
Вземания	43 683	7 516	21 310	0	0.00%
Разходи за бъдещи периоди	857	684	516	342	0.00%
Общо:	7 636 039	7 881 426	7 914 705	7 774 507	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “СКАЙ Нови Акции” акции

Дружество	30.9.2016			31.10.2016			
	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							
Софарма АД - София	85035	2.95	250598	85035	3.01	256040	3.29%
НЕОХИМ АД - ДИМИТРОВГРАД				212	54.54	11563	0.15%
М и С ХИДРАВЛИК АД	11490	5.35	61494	11490	5.65	64919	0.84%
ЗЪРНЕНИ ХРАНИ БЪЛГАРИЯ АД	9766	0.32	3106	9766	0.33	3242	0.04%
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	282929	0.67	188431	272929	0.32	85973	1.11%
Монбат АД	20000	7.68	153640	20000	8.03	160620	2.07%
София Комерс - заложни къщи АД	4812	3.65	17564	4812	3.80	18286	0.24%
Албена инвест холдинг	7017	9.16	64283	7017	9.16	64283	0.83%

¹ Цени в съответната валута

Химимпорт АД	62578	1.36	84918	62578	1.48	92490	1.19%
СИРМА ГРУП ХОЛДИНГ АД	33333	1.06	35166	33333	1.03	34333	0.44%
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.00	149	149450	0.00	149	0.00%
ЧЕЗ РАЗПРЕДЕЛЕНИЕ БЪЛГАРИЯ АД	600	125.62	75374	600	135.17	81103	1.04%
Индустриален Холдинг България АД	48333	0.93	45046	48333	0.93	44853	0.58%
ИД Елана високодоходен фонд	3316	97.01	321690	3316	95.32	316077	4.07%
Общо:			1301460			1233931	15.87%
АКЦИИ ХЪРВАТСКА							
KONCHAR ELECTROINDUSTRIJA D.D.	844	677.00	148569	844	680.00	149480	1.92%
KONCHAR TRANSFORMATORI	412	1380.00	147834	412	1549.00	166219	2.14%
Duro Dakovic holding	1000	50.76	13198	1000	49.85	12984	0.17%
Atlanska Plovitba D.D. DUBROVNIK	730	180.02	34170	730	300.00	57039	0.73%
Adris P-A	560	437.50	63704	560	452.00	65926	0.85%
Общо:			407475			451648	5.81%
АКЦИИ РУМЪНИЯ							
CNTEE TRANSELECTRICA SA	29275	29.30	376682	29275	29.15	370404	4.76%
TRANSGAZ SA MEDIAS	900	306.00	120941	900	298.00	116412	1.50%
Petrom Bucuresti	3000000	0.24	321456	3000000	0.23	293635	3.78%
S.N.G.N. ROMGAZ S.A.	5000	23.25	51051	5000	23.45	50892	0.65%
SIF OLTENIA CRAIOVA	335000	1.55	228027	335000	1.49	216656	2.79%
SIF Transilvania /SIF 3/	400000	0.28	49097	400000	0.25	43145	0.55%
SIF MOLDOVA BACAU	468000	0.76	155785	468000	0.77	155805	2.00%
SIF Banat Crisana /SIF 1/	250000	1.66	182246	250000	1.68	182735	2.35%

SNO - Santierul Naval Orsova	17700	2.46	19121	17700	2.54	19514	0.25%
Farmaceutica Remedia SA	104000	0.20	9226	104000	0.21	9480	0.12%
SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/	1466649	0.80	517192	1466649	0.81	513099	6.60%
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	24420	11.00	117964	24420	10.98	116383	1.50%
ОБЦО			2148786			2088159	26.86%
АКЦИИ СЪРБИЯ							
Veterinarski zavod AD	3017	295.00	14119	3017	289.00	13846	0.18%
Novosadski sajam a.d. Novi Sad	1745	1050.10	29068	1745	400.00	11084	0.14%
NIS AD NOVI SAD	3881	590.00	36324	3881	656.00	40430	0.52%
RTC LUKA LEGET A.D.	223	3170.75	11217	223	3170.75	11228	0.14%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	210	1548.00	5157	210	1661.00	5539	0.07%
ALFA PLAM a.d. Vranje	266	32000.00	135028	266	34000.00	143620	1.85%
Agrobanka a.d. Beograd	132	0.01	0	132	0.01	0	0.00%
Общо			230912			225748	2.90%
АКЦИИ ТУРЦИЯ							
TURK TRAKTOR	6500	81.45	308394	6500	80.30	300558	3.87%
TAV HAVALIMANLARI	33000	12.37	237786	33000	12.72	241713	3.11%
MIGROS	6000	18.28	63889	6000	17.79	61465	0.79%
Enka Insaat Ve Sanayi AS	26130	4.39	66820	26130	4.72	71020	0.91%
YAPI VE KREDI BANKASI	63000	3.67	134682	63000	3.70	134228	1.73%
Turkcell	15000	9.71	84842	15000	9.97	86116	1.11%
Haci Omer Sabanci Holding	16888	9.29	91389	16888	9.35	90926	1.17%
KOC HOLDING	34755	12.89	260959	34755	12.90	258170	3.32%
iŞ BANKASI (C)	33800	4.75	93522	33800	5.02	97706	1.26%

T. GARANTI BANKASI	42500	7.95	196815	42500	8.41	205819	2.65%
EREĖLI DEMİR CELİK /EREGL	62000	4.13	149157	62000	4.20	149948	1.93%
Arcelik /ARCLK.E	21000	21.12	258354	21000	20.44	247172	3.18%
ADANA CIMENTO C	219360	0.72	92001	219360	0.81	102316	1.32%
ADANA CIMENTO A	21000	6.07	74252	21000	6.23	75337	0.97%
Общо			2112862			2122494	27.30%
АКЦИИ СЛОВЕНИЯ							
KRKA DD	5475	61.90	662836	5475	58.50	626428	8.06%
ZAVAROVALNICA TRIGLAV	4483	22.50	197280	4483	23.11	202628	2.61%
Общо			860115			829056	10.66%
ISHARES JPM EMERG BOND	1400	103.14	282414	1400	103.96	284659	3.66%
Общо:			7344025			7235694	93.07%

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:

10.11.2016 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.