

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

01.5.2016 г. - 31.5.2016 г.

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

Към края на месец май нетните активи на фонда са 5123407.13 лв., което представлява намаление от -74283.01 лв. спрямо края на месец април. Броят на емитираните дялове остава без промяна на 26515.3816.

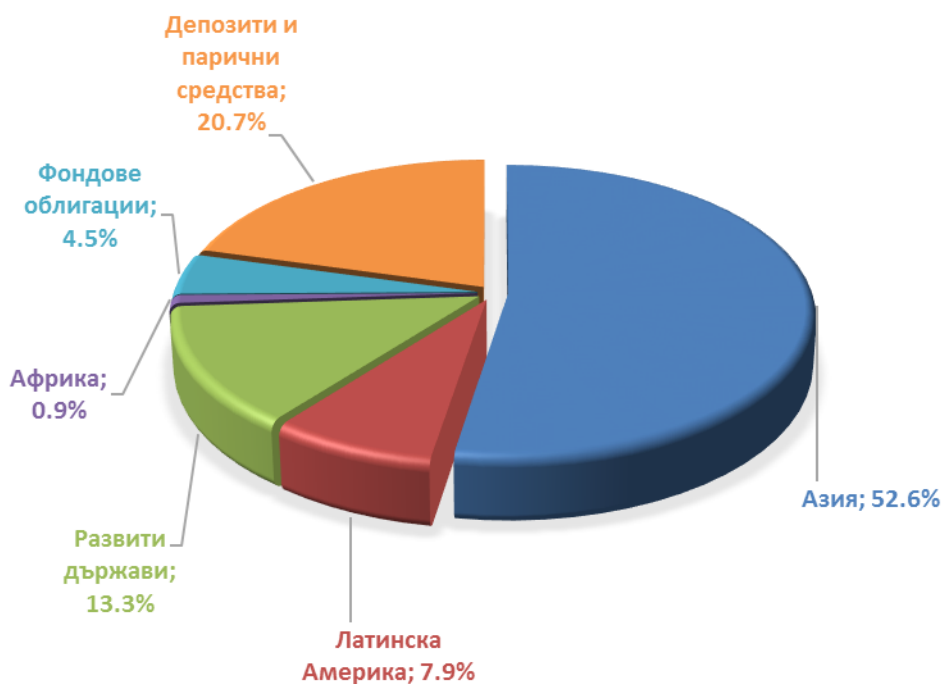
### Представяне на индексите на развиващите се пазари

MSCI Index	MTD	3MTD	YTD	1 Yr	3 Yr	5 Yr	10 Yr
Китай	1.9%	7.9%	-8.2%	-31.3%	2.8%	0.9%	6.3%
Индия	4.7%	12.5%	-3.1%	-10.3%	8.0%	3.3%	6.5%
Индонезия	-1.7%	-5.5%	1.9%	-13.0%	-6.5%	-0.8%	9.2%
Корея	-1.9%	5.5%	-3.0%	-13.8%	0.7%	0.4%	2.8%
Малайзия	-5.2%	-1.6%	-1.5%	-18.3%	-7.9%	-1.3%	5.3%
Филипини	7.3%	10.8%	4.7%	-7.2%	5.2%	16.8%	13.4%
Тайван	4.7%	2.0%	1.3%	-19.3%	4.4%	2.3%	2.3%
Тайланд	3.0%	4.3%	12.9%	-12.5%	-3.2%	4.3%	7.9%
Бразилия	-11.3%	20.8%	18.0%	-22.2%	-16.6%	-15.0%	-1.7%
Чили	-4.8%	1.4%	3.7%	-16.9%	-10.5%	-9.3%	2.8%
Колумбия	-9.0%	9.0%	11.6%	-22.6%	-18.5%	-10.8%	2.7%
Мексико	-5.5%	-0.7%	-3.3%	-16.9%	-4.2%	1.1%	4.4%
Перу	-3.6%	18.5%	30.5%	-7.5%	0.6%	-1.1%	9.7%
Латинска Америка	-8.5%	10.3%	8.7%	-19.6%	-12.2%	-10.1%	0.3%
Чехия	-2.9%	8.9%	-2.6%	-20.4%	-4.9%	-10.8%	-3.3%
Унгария	-4.0%	11.8%	10.3%	15.8%	3.0%	-4.9%	-3.3%
Полша	-5.5%	-3.1%	-6.1%	-30.7%	-10.1%	-10.4%	-4.7%
Русия	-3.1%	13.6%	14.6%	-11.4%	-8.7%	-9.4%	-6.2%
Турция	-11.4%	0.1%	5.1%	-15.9%	-12.5%	-2.6%	1.3%
Египет	-2.9%	10.8%	-3.2%	-24.0%	8.6%	4.3%	1.4%
Южна Африка	-6.8%	7.4%	3.6%	-22.8%	-0.3%	-1.7%	2.2%
Развиваща се Азия	1.5%	5.7%	-3.4%	-21.1%	1.8%	1.4%	4.2%
Развиващи се пазари	-1.1%	6.5%	-0.8%	-20.8%	-2.3%	-2.2%	2.2%

Към 31.5.2016 г.

Липсата на посока при развитите пазари продължи и през май. От една страна представянето на повечето компании е по-добро от доста негативните очакванията, които доминираха началото на годината. Но от друга страна макро факторите продължават да натискат пазарите. Редица изявления на управители на ФЕД навяват на мисълта, че на линия е поредно вдигане на лихвите в САЩ. През юни Великобритания ще държи референдум за оставане в ЕС. Тази двойствена природа на относително добри резултати на отделни компании и на макро несигурност водят и до различно представяне на отделни пазари. Тези, при които макро рискът е водещ – както са повечето развиващи се пазари и южна Европа – бяха под натиск, от друга страна американските пазари и северна Европа, които се разглеждат като по-малко повлияни от макро рискове, се представиха по-добре.

**Разпределение на активите на фонда по региони**



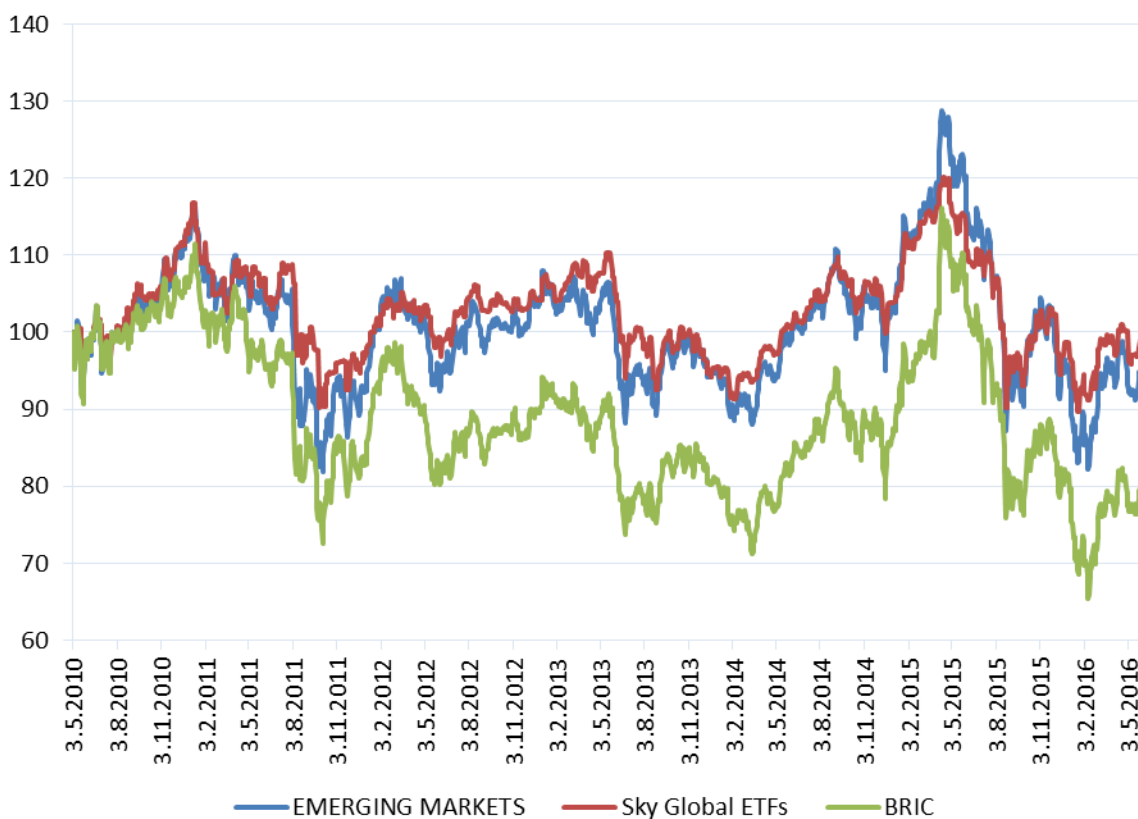
**Стойност на портфейла в началото и в края на отчетния период в лева**

Активи	31.03.2016	30.04.2016	31.05.2016	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Дялове в КИС, акции и права	4 082 034	4 049 209	4 067 599	79.3%
Облигации	0	0	0	0.0%
Парични средства	1 071 877	1 064 233	1 056 711	20.60%
Депозити до 3 мес.	0	0	0	0.00%
Вземания	0	1 028	2 981	0.1%
Други	1 540	1 372	1 199	0.02%
<b>Общо:</b>	<b>5 155 451</b>	<b>5 115 842</b>	<b>5 128 490</b>	<b>100.0%</b>

**Информация за паричните средства**

Към 31.5.2016 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 2015	Април 2016	Май 2016	
Доходност MSCI EM	-0.7%	14.8%	-3.8%	-18.7%	3.03%	0.45%	-0.1%	-1.13%	
Доходност ДФ Скай Глобал ETFs	-2%	10.23%	-5.4%	-13.6%	4.44%	0.92%	0.66%	-1.43%	
Стандартно отклонение на ДФ Скай Глобал ETFs								18.04%	

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

Company	30.4.2016				31.5.2016			
	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	8.45	49580.29	0.97%	3000	7.79	45707.75	0.89%
DB X-TRACKERS MSCI SINGAPORE	53000	0.998	103451.67	2.02%	53000	0.984	102000.45	1.99%
DB X-TRACKERS MSCI PHILIPPINES IM TRN INDEX UCITS ETF	25600	1.668	83515.51	1.63%	25600	1.828	91526.59	1.78%
MULTI UNITS LUXEMBOURG-LYXOR ETF AUSTRALIA (S&P ASX)	2500	36.89	180376.42	3.53%	2500	37.2	181892.19	3.55%
DB X-TRACKERS MSCI INDONESIA TRN INDEX ETF	5499	11.09	119274.16	2.33%	5499	10.98	118091.1	2.30%
DB X-TRACKERS MSCI MEXICO	21565	4.304	181531.85	3.55%	21565	4.143	174741.27	3.41%
DB X-TRACKERS FTSE VIETNAM ETF	845	20.07	33169.21	0.65%	845	20.93	34590.52	0.67%
DB X-TRACKERS MSCI AC ASIA X-JP	1100	27.79	59787.77	1.17%	1100	28.33	60949.53	1.19%
AMUNDI FUNDS ASEAN NEW MARKETS-C (USD)	1720.45	85.38	252945.12	4.94%	1720.45	83.11	250724.14	4.89%
DB X-TRACKER NIFTY 50 UCITS ETF	1000	105.27	205890.22	4.02%	1000	111.39	217859.9	4.25%
DB X-TRACKERS MSCI TAIWAN	3833	16.65	124819.99	2.44%	3833	17.57	131716.96	2.57%
DB X-TRACKERS MSCI EM ASIA	1020	31.37	62581.47	1.22%	1020	32	63838.29	1.24%
DB X-TRACKERS MSCI KOREA TRN	1301	46.55	118448.1	2.32%	1301	45.97	116972.27	2.28%
AMUNDI FUNDS THAILAND (USD)	1437.028	121.21	299938.2	5.86%	1437.028	121.01	304920.98	5.95%
FIDELITY FUNDS-INDONESIA FUND A (USD)	1500	24.58	63489.4	1.24%	1500	23.72	62388.82	1.22%

<sup>1</sup> Цена в оригинална валута

ISHARES MSCI BRAZIL	1100	45.74	98405.63	1.92%	1100	40.9	87992.79	1.72%
iSHARES MSCI CANADA B	1307	95.02	242896.76	4.75%	1307	95.17	243280.2	4.74%
ISHARES MSCI AC FAR EAST XJP	1720	35.83	120533.11	2.36%	1720	36.38	122383.32	2.39%
ISHARES MSCI TAIWAN	3823	28.07	209883.27	4.10%	3823	29.61	221398.06	4.32%
ISHARES MSCI KOREA	3562	29.43	205028.99	4.01%	3562	29.02	202172.66	3.94%
LYXOR ETF MSCI TAIWAN	5800	8.858	100483.5	1.96%	5800	9.35	106064.66	2.07%
LYXOR BRAZIL (IBOVESPA) UCITS ETF	3000	12.34	72404.83	1.42%	3000	11.02	64659.74	1.26%
LYXOR ETF MSCI MALAYSIA	7994	14.13	220921.21	4.32%	7994	13.48	210758.52	4.11%
LYXOR ETF KOREA	608	41.14	48921.41	0.96%	608	40.5	48160.36	0.94%
LYXOR ETF MSCI INDIA	2480	12.81	62134.37	1.21%	2480	13.49	65432.68	1.28%
LYXOR ETF MSCI AC ASIA PACIFIC EX JAPAN	1524	39.15	116693.81	2.28%	1524	39.79	118601.45	2.31%
ISHARES JPM EMERG BOND	1200	97.02	227705.55	4.45%	1200	98.67	231578.1	4.52%
ISHARES MSCI AC FAR EAST EX-JAPAN SMALL CAP	1100	22.6	48621.93	0.95%	1100	22.5	48406.79	0.94%
ISHARES STOXX EUROPE 600 AUTOMOBILES & PARTS UCITS ETF	1300	47.89	121764.11	2.38%	1300	48.53	123391.36	2.41%
ISHARES MSCI EM LATIN AMERICA UCITS ETF	3400	13.08	86979.67	1.70%	3400	11.99	79731.37	1.55%
ISHARES NIKKEI 225	5000	12.99	127031.16	2.48%	5000	13.873	135666.15	2.65%
			4 049 208.69	79.15%			4 067 598.97	79.31%

**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:**

10.6.2016 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. Предидните резултати от дейността на фондовете нямат по необходимост връзка с бъдещите такива. Проспектът, документа с ключова информация за инвеститорите и правилата на организираниите 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.