

ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ НОВИ АКЦИИ”

01.02.2022г. - 28.02.2022г.

Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на месец февруари нетните активи на фонда са 8 153 721 лв., което представлява намаление с 587 345 лв. спрямо края на месец януари. Броят на емитираните дялове намалява с 51 355.9927 до 10 273 730.3884.

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

Изменение	Q1 2021	Q2 2021	Q3 2021	Q4 2021	Декември 2021	Януари 2022	Февруари 2022
SOFIX	12.23%	11.03%	4.96%	8.60%	2.08%	-2.70%	-3.77%
CROBEX	7.64%	5.78%	0.95%	4.01%	4.96%	2.56%	-6.23%
BELEX 15	0.77%	3.32%	3.00%	2.24%	1.32%	4.64%	-2.82%
BET-XT	13.67%	6.17%	6.35%	2.13%	6.06%	0.31%	-3.93%
ISE 100	-5.76%	-2.54%	3.69%	32.09%	2.65%	7.84%	-2.85%
ДФ Скай Нови Акции	4.25%	3.48%	2.82%	1.75%	3.90%	1.96%	-6.26%
Средно аритметично за индексите	5.71%	4.75%	3.79%	9.81%	3.42%	2.59%	-3.92%
ДФ Скай Нови Акции стандартно отклонение ¹							9.51%
Дял на съответната държава от активите на фонда	31.12.2020	31.3.2021	30.6.2021	30.9.2021	31.12.2021	31.01.2022	28.02.2022
България	12.29%	12.72%	13.38%	14.12%	13.82%	13.47%	14.27%
Хърватска	6.59%	7.53%	8.43%	8.61%	9.48%	10.09%	9.94%
Сърбия	4.07%	3.93%	3.77%	4.56%	4.65%	5.00%	5.29%
Румъния	26.72%	28.80%	28.48%	27.26%	26.57%	25.84%	27.15%
Турция	18.81%	16.03%	14.43%	14.17%	13.40%	13.97%	13.81%
Словения	14.55%	14.70%	14.25%	14.57%	15.30%	13.70%	11.50%
Други	5.57%	5.79%	5.69%	5.36%	5.47%	5.40%	5.41%

¹ Стандартното отклонение е измерено на седмична база за последните 52 седмици

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

Промяната на индексите е в местна валута. До голяма степен именно поради значителния спад на някои валути към еврото се дължи и разминаването 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.

Всички са изненадани от случващото се в Украйна. В това число и участниците на финансовите пазари. В момента всичко друго остава на заден план – инфлация, ковид, монетарни политики – темите, които движеха пазарите до момента на нахлуване на руски войски в Украйна.

Светът се промени за няколко дни. Или може би по-точно на повърхността излезе таено от години противостоене между геополитически сили. Противостоене още от годините на Втората световна война, през това от Студената война, Перестройката, та до днес. През цялото това време военните сили от двете страни неслучайно са в 24/7 готовност за нанасяне на разрушителни уреди – 10 секунди след изстрел от едната страна, ще последва изстрел от другата... А сега се говори навсякъде по света за война, танкове, оръжия, бомбоубежища, жертви, бежанци...

След постигане на целите на тази военна офанзива, които все още не са еднозначно дефинирани, и ако приемем, че конфликтът остане и приключи на територията на Украйна, светът вече е променен.

Обратно към финансовите пазари: Русия ще бъде изолирана. Лостът за въздействие върху лидера на Федерацията е неговото обкръжение. Икономическите щети върху едрите руски бизнеси и собственици на активи са най-логичното противодействие в тази ситуация. Именно то според мен ще предопределя в средносрочен план настроенията на финансовите пазари.

Важен фактор ще е Китай. Демократичният свят разчита на икономическите интереси на Китай към пазарите на САЩ и Европа. Ако те наистина са решаващи за Китай, тогава изолацията на Русия ще постигне бързо резултат за смяна на режима и положението би трябвало да се нормализира. През това време доставките на природни ресурси от Русия ще са нестабилни, бизнесът с Русия също, в това число руски бизнес с международни контрагенти, участия в руски бизнес, бизнеси с дейност в Русия, бизнес, зависещ от руски доставки. Възможности от развиващата се ситуация виждам в търсенето на алтернативи-заместители на руски контрагенти. Тези процеси разместват оценките на редица бизнеси и допълнително увеличават волатилността на финансовите пазари.

Въпреки всичко, до момента индексите на пазарите на акции не чертаят необичайни графики. Ако се абстрахираме от всичко и гледаме само цените, виждаме обичайни корективни движения, поне до момента. Това според мен показва, че ликвидността на пазарите е голяма и участниците очакват допълнително наливане на ликвидност чрез ново разхлабване на монетарната политика и подпомагане на пострадалите от кризата бизнеси. Също така акциите, заедно с долара, златото и крипто активите са убежище за капитала, държан в девалвиращи в момента валути. Затова смятам, че значителни пропадания на тези пазари в следствие на моментен страх са възможност за увеличаване на някои експозиции във фондовете за сметка на „кеша“.

Представяне на фонда за последната година - по месеци

Доходност по месеци	Средно аритметично за индексите	DFNEW
Февруари 2021	0.55%	0.36%
Март 2021	1.58%	0.92%
Април 2021	1.47%	1.60%
Май 2021	1.28%	0.23%
Юни 2021	1.91%	1.61%
Юли 2021	0.47%	2.68%
Август 2021	2.43%	1.94%
Септември 2021	0.92%	-1.77%
Октомври 2021	1.75%	-0.11%
Ноември 2021	4.22%	-1.99%
Декември 2021	3.42%	3.90%
Януари 2022	2.59%	1.96%
Февруари 2022	-3.92%	-6.26%

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

Активи	31.10.2021	30.11.2021	31.12.2021	31.01.2022	28.02.2022	Структура на активите спрямо общата им стойност %/
Акции и права и КИС	7 508 715	7 282 912	7 610 506	7 669 541	7 146 189.56	87.37%
Облигации	-	-	-	-	-	
Парични средства	936 729	990 276	969 067	1 071 743	1 030 642.66	12.60%
Депозити до 3 мес.						0.00%
Вземания	877	850	1 723	25227	-	0.00%
Разходи за бъдещи периоди	396	202	-	2196	2012.37	0.02%
Общо:	8 446 717	8 274 240	8 581 295	8 768 708	8 178 844.59	100.00%

Информация за паричните средства

Към 28.02.2022 г. Фондът няма депозити. Паричните средства са по сметки на Фонда в банката-депозитар Юробанк България АД.

Стойност на притежаваните от ДФ “СКАЙ Нови Акции” финансови инструменти

Дружество	31.01.2022				28.02.2022			
	Брой ценни книжа	Цена за брой ²	Балансова стойност в лв	Процент от активите	Брой ценни книжа	Цена за брой ¹	Балансова стойност в лв	Процент от активите
АКЦИИ БЪЛГАРИЯ								
СОФАРМА АД - СОФИЯ	85035	4.50	382913	4.37%	85035	4.4981	382495.93	4.68%
АЛБЕНА АД	1213	32.32	39203	0.45%	1213	31.3000	37966.90	0.46%
ЗЪРНЕНИ ХРАНИ БЪЛГАРИЯ АД	9766	0.16	1514	0.02%	9766	0.1470	1435.60	0.02%
СОФИЯ КОМЕРС - ЗАЛОЖНИ КЪЩИ 2	4812	8.50	40902	0.47%	4812	8.4048	40443.90	0.49%
ХИМИМПОРТ АД	62578	0.90	56164	0.64%	62578	0.8050	50375.29	0.62%

² Цени в съответната валута

ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	129450	0.00	129	0.00%	129450	0.0010	129.45	0.00%
ИНДУСТРИАЛЕН ХОЛДИНГ БЪЛГАРИЯ АД	48333	2.03	98116	1.12%	48333	1.9200	92799.36	1.13%
ЦКБ АД	104527	1.18	123446	1.41%	104527	1.0930	114248.01	1.40%
ИД ЕЛАНА ВИСОКОДОХОДЕН ФОНД	3316	132.33	438820	5.00%	3316	134.9763	447581.41	5.47%
ОБЩО:			1 181 207	13.47%			1 167 475.85	14.27%
АКЦИИ ХЪРВАТСКА								
KONCHAR ELECTROINDUSTRIJA D.D.	844	900.00	197316	2.25%	844	865.0000	188735.11	2.31%
KONCHAR TRANSFORMATORI	824	2580.00	552235	6.30%	824	2300.0000	489947.10	5.99%
ATLANSKA PLOVITVA D.D. DUBROVNIK	730	388.00	73575	0.84%	730	408.0000	76997.60	0.94%
ADRIS P-A	560	424.00	61678	0.70%	560	395.0000	57184.62	0.70%
ОБЩО:			884 805	10.09%			812 864.43	9.94%
АКЦИИ РУМЪНИЯ								
CNTEE TRANSELECTRICA SA	28188	21.00	234007	2.67%	28188	18.9000	210568.04	2.57%
TRANSGAZ SA MEDIAS	900	223.00	79340	0.90%	900	200.0000	71144.10	0.87%
S.N.G.N. ROMGAZ S.A.	5000	37.85	74814	0.85%	5000	38.5000	76084.66	0.93%
SIF OLTENIA CRAIOVA	335000	1.67	221160	2.52%	335000	1.8900	250249.37	3.06%
SIF TRANSILVANIA /SIF 3/	400000	0.34	53447	0.61%	400000	0.3150	49800.87	0.61%
EVERGENT INVESTMENTS S.A.	433307	1.22	208978	2.38%	433307	1.1850	202945.98	2.48%
SIF BANAT CRISANA /SIF 1/	250000	2.38	235214	2.68%	250000	2.2500	222325.31	2.72%
SNO - SANTIERUL NAVAL ORSOVA	17700	5.45	38134	0.43%	17700	5.8000	40575.85	0.50%
FARMACEUTICA REMEDIA SA	104000	0.70	28861	0.33%	104000	0.6720	27622.88	0.34%
SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/	1119562	2.04	900654	10.27%	1119562	1.9820	877037.54	10.72%
BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE BUCURESTI	24420	19.78	190949	2.18%	24420	19.8800	191879.43	2.35%

ОБЩО			2 265 558	25.84%			2 220 234.03	27.15%
АКЦИИ СЪРБИЯ								
NOVOSADSKI SAJAM A.D. NOVI SAD	1740	485.83	14061	0.16%	1740	650.0000	18800.40	0.23%
NIS AD NOVI SAD	3881	616.00	39765	0.45%	3881	598.0000	38578.85	0.47%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	3210	4963.00	264989	3.02%	3210	4875.3746	260146.21	3.18%
ALFA PLAM A.D. VRANJE	266	26999.00	119456	1.36%	266	26000.0000	114963.36	1.41%
AGROBANKA A.D. BEOGRAD	132	0.01	0	0.00%	132	0.0050	0.01	0.00%
ОБЩО			438 271	5.00%			432 488.83	5.29%
АКЦИИ ТУРЦИЯ								
TURK TRAKTOR	6500	220.10	187402	2.14%	6500	212.8000	175064.71	2.14%
MIGROS	6000	40.82	32082	0.37%	6000	36.0000	27338.04	0.33%
ENKA INSAAT VE SANAYI AS	34840	15.66	71468	0.82%	34840	12.2500	54016.66	0.66%
YAPI VE KREDI BANKASI	122419	4.08	65426	0.75%	122419	3.5800	55468.38	0.68%
TURKCELL	15000	18.69	36723	0.42%	15000	20.5200	38956.71	0.48%
TURKIYE SISE VE CAM FABRIKALARI A.S.	97179	13.80	175669	2.00%	97179	12.3800	152268.06	1.86%
OYAK CIMENTOFABRIKALARI ANONIM SIR	191543	9.05	227068	2.59%	191543	7.2600	176001.38	2.15%
T. GARANTI BANKASI	42500	11.91	66304	0.76%	42500	11.0800	59599.46	0.73%
EREĞLİ DEMİR ÇELİK /EREGL	62000	27.28	221553	2.53%	62000	31.0800	243885.69	2.98%
ARCELİK /ARCLK.E	21000	51.45	141529	1.61%	21000	55.3500	147112.83	1.80%
ОБЩО			1 225 225	13.97%			1 129 711.92	13.81%
АКЦИИ СЛОВЕНИЯ								
TELEKOM SLOVENIJE	610	58.20	69436	0.79%	610	55.2000	65856.71	0.81%
KRKA DD	3500	115.00	787222	8.98%	3500	83.0000	568168.62	6.95%
ZAVAROVALNICA TRIGLAV	4483	39.30	344582	3.93%	4483	35.0000	306879.51	3.75%

ОБЩО			1 201 239	13.70%			940 904.84	11.50%
ДРУГИ								
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	1200	92.95	218153	2.49%	1200	86.5600	203155.97	2.48%
ISHARES JPM EMERG BOND	1400	93.16	255082	2.91%	1400	87.4140	239353.69	2.93%
Общо:			473 235	5.40%			442 509.66	5.41%
Общо:			7 669 541	87.46%%			7 146 189.56	87.37%%

Репо сделки

През периода не са сключвани договори за репо сделки, както и няма прекратени такива договори; не са закупвани, и не са продавани финансови инструменти по репо сделки; към края на периода няма действащи договори за репо сделки.

Сделки с деривати и хеджиращи сделки

Фондът не притежава деривативни инструменти и не са сключвани сделки с такива. Не са сключвани хеджиращи сделки и няма отворена хеджираща позиция.

Дата на съставяне:

07.03.2022 г.

Съставил:

Явор Спасов

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.