

ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ НОВИ АКЦИИ”

01.11.2016 г. - 30.11.2016 г.

Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на месец ноември нетните активи на фонда са 7 460 194.54лв., което представлява намаление от -292 851.95 лв. спрямо края на месец октомври. Броят на емитираните дялове се увеличава с 220.6796 и достига 11 278 335.4989.

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

Изменение	Q3 2015	Q4 2015	Q1 2016	Q2 2016	Q3 2016	Ноември 2016
SOFIX	4.03%	-3.2%	-0.24%	2.06%	10.8%	5.83%
CROBEX	0.24%	-1.2%	3.43%	0.38%	15.8%	1.98%
BELEX 15	2.51%	-5.9%	3.13%	-0.23%	5.2%	2.51%
BET-XT	0.17%	-4.5%	4.81%	-4.07%	7.1%	0.51%
ISE 100	-5.51%	16.1%	9.83%	-7.75%	-0.4%	-5.78%
DFNEW	-1.04%	2.04%	5.20%	-3.82%	5.17%	-3.77%
Средно аритметично за индексите	0.29%	0.3%	4.19%	-1.92%	7.7%	1.01%
Дял на съответната държава от активите на фонда	30.09.2015	31.12.2015	31.03.2016	30.06.2016	30.09.2016	30.11.2016
България	13.83%	14.07%	13.41%	14.12%	16.44%	16.12%
Хърватска	4.53%	4.70%	4.73%	4.91%	5.15%	6.10%
Сърбия	3.61%	4.11%	4.18%	4.09%	2.92%	2.96%
Румъния	28.83%	28.70%	26.64%	26.19%	27.15%	28.07%
Турция	27.15%	26.67%	30.64%	28.97%	26.70%	25.34%
Словения	10.68%	11.71%	11.42%	10.73%	10.87%	9.86%
Други	3.30%	3.43%	3.37%	3.71%	3.57%	3.75%

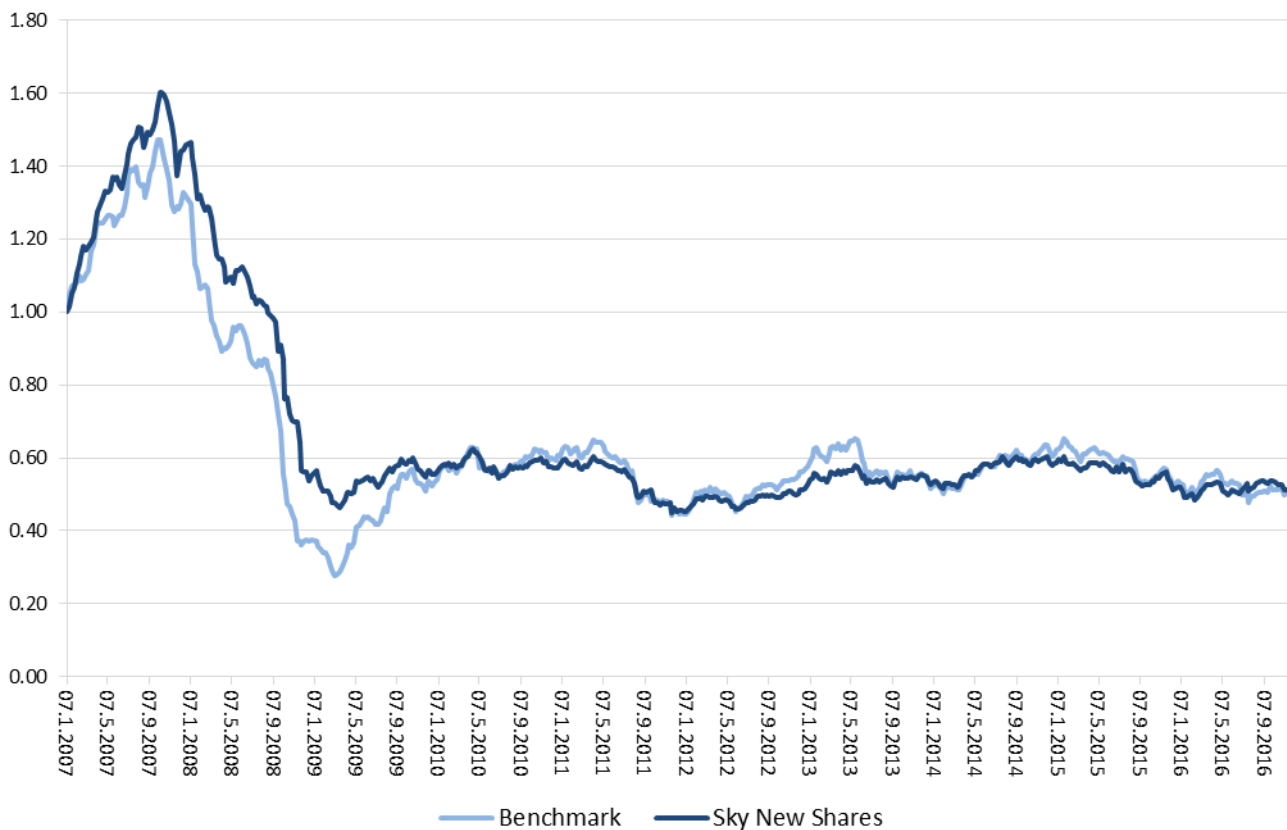
Информация за паричните средства

Към 30.11.2016 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	9.75%	28.79%	9.41%
CROBEX	8.89%	18.31%	11.48%
BELEX 15	14.16%	12.35%	-0.33%
BET-XT	12.96%	-3.44%	-1.30%
ISE 100	24.94%	-1.65%	-14.13%
Служебен бенчмарк	14.51%	10.87%	1.03%
DFNEW	12.51%	-6.20%	-15.28%

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


Последните двадесет години световната икономика се характеризираше с постоянен стремеж към нарастване на търговските и финансовите връзки между държавите. Това усещане, че светът все повече се превръща в глобално село, макар и от време на време да преминава през периоди на негативизъм, в общия случай се приемаше като нещо неотменимо. Развиващите се пазари търгуват все повече с развитите – и то не само ресурси. Китай се превръща във фабриката на света. Поради изнасянето на производства и завоюване на нови пазари все по-трудно става да се каже дадена корпорация каква всъщност е по народност.

И в момента, поне ако се вярва на приказките на Тръмп, може би вече идва края на този период. Нарастването на протекционизма, пречки пред изнасянето на производства, данъчни санкции. Това са поне началните заявки на все още нестъпилия в длъжност президент. Съвсем резонно това доведе до сериозни спадове сред развиващите се пазари. Не е съвсем сигурно, че тази спиратка пред глобализацията наистина ще се случи. Но както се казва, на пазара се купуват слухове и се продават новини. Към момента има вероятност – макар да отбележим не особено голяма, противниците на глобализацията да могат да видят какъв би бил света в 21 век при прилагане на търговски мерки от 19 век.

Представяне на фонда за последната година - по месеци

Доходност по месеци	Средно аритметично за индексите	DFNEW
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%
Ноември 2016	1.01%	-3.77%

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

Активи	31.8.2016	30.9.2016	31.10.2016	30.11.2016	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права и КИС	7 256 935	7 344 025	7 235 694	6 897 194	92.20%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	616 293	548 854	538 471	583 147	7.80%
Депозити до 3 мес.	0	0	0	0	0.00%
Вземания	7 516	21 310	0	0	0.00%
Разходи за бъдещи периоди	684	516	342	174	0.00%
Общо:	7 881 426	7 914 705	7 774 507	7 480 515	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “СКАЙ Нови Акции” акции

Дружество	31.10.2016			30.11.2016			
	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	3.011	256040	85035	2.95	250598	3.35%
НЕОХИМ АД - ДИМИТРОВГРАД	212	54.543	11563	212	58.51	12404	0.17%
М и С ХИДРАВЛИК АД	11490	5.650	64919	11490	6.12	70296	0.94%
Албена АД				1213	60.82	73776	0.99%
АЛБЕНА ИНВЕСТ - ХОЛДИНГ АД	7017	9.161	64283				
ЗЪРНЕНИ ХРАНИ БЪЛГАРИЯ АД	9766	0.332	3242	9766	0.34	3350	0.04%
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	272929	0.315	85973	130000	0.24	31200	0.42%
Монбат АД	20000	8.031	160620	20000	9.27	185360	2.48%
София Комерс - заложни къщи 2	4812	3.800	18286	4812	3.52	16938	0.23%

¹ Цени в съответната валута

Химимпорт АД	62578	1.478	92490	62578	1.59	99624	1.33%
СИРМА ГРУП ХОЛДИНГ АД	33333	1.030	34333				
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.001	149	149450	0.00	149	0.00%
ЧЕЗ РАЗПРЕДЕЛЕНИЕ БЪЛГАРИЯ АД	600	135.171	81103	600	154.63	92779	1.24%
Индустриален Холдинг България АД	48333	0.928	44853	48333	1.02	49300	0.66%
ИД Елана високодоходен фонд	3316	95.319	316077	3316	96.63	320417	4.28%
Общо:			1233931			1206191	16.12%
АКЦИИ ХЪРВАТСКА							
KONCHAR ELECTROINDUSTRIJA D.D.	844	680.00	149480	844	685.00	150010	2.01%
KONCHAR TRANSFORMATORI	412	1549.00	166219	412	1525.00	163025	2.18%
Duro Dakovic holding	1000	49.85	12984	1000	47.55	12338	0.16%
Atlanska Plovitba D.D. DUBROVNIK	730	300.00	57039	730	335.00	63453	0.85%
Adris P-A	560	452.00	65926	560	462.30	67174	0.90%
Общо:			451648			456000	6.10%
АКЦИИ РУМЪНИЯ							
CNTEE TRANSELECTRICA SA	29275	29.15	370404	29275	29.15	370568	4.95%
TRANSGAZ SA MEDIAS	900	298.00	116412	900	298.00	116464	1.56%
Petrom Bucuresti	3000000	0.23	293635	3000000	0.23	299628	4.01%
S.N.G.N. ROMGAZ S.A.	5000	23.45	50892	5000	24.20	52543	0.70%
SIF OLTENIA CRAIOVA	335000	1.49	216656	335000	1.57	228681	3.06%
SIF Transilvania /SIF 3/	400000	0.25	43145	400000	0.25	42903	0.57%
SIF MOLDOVA BACAU	468000	0.77	155805	468000	0.77	155874	2.08%
SIF Banat Crisana /SIF 1/	250000	1.68	182735	250000	1.72	186290	2.49%

SNO - Santierul Naval Orsova	17700	2.54	19514	17700	2.78	21367	0.29%
Farmaceutica Remedia SA	104000	0.21	9480	104000	0.21	9258	0.12%
SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/	1466649	0.81	513099	1466649	0.79	500589	6.69%
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	24420	10.98	116383	24420	10.90	115586	1.55%
ОБЦО			2088159			2099753	28.07%
АКЦИИ СЪРБИЯ							
Veterinarski zavod AD	3017	289.00	13846	3017	289.00	13842	0.19%
Novosadski sajam a.d. Novi Sad	1745	400.00	11084	1745	401.00	11109	0.15%
NIS AD NOVI SAD	3881	656.00	40430	3881	674.00	41527	0.56%
RTC LUKA LEGET A.D.	223	3170.75	11228	223	3170.75	11225	0.15%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	210	1661.00	5539	210	1790.00	5968	0.08%
ALFA PLAM a.d. Vranje	266	34000.00	143620	266	32662.00	137926	1.84%
Agrobanka a.d. Beograd	132	0.01	0	132	0.01	0	0.00%
Общо			225748			221596	2.96%
АКЦИИ ТУРЦИЯ							
TURK TRAKTOR	6500	80.30	300558	6500	73.00	255153	3.41%
TAV HAVALIMANLARI	33000	12.72	241713	33000	12.93	229444	3.07%
MIGROS	6000	17.79	61465	6000	17.31	55849	0.75%
Enka Insaat Ve Sanayi AS	26130	4.72	71020	26130	4.67	65618	0.88%
YAPI VE KREDI BANKASI	63000	3.70	134228	63000	3.12	105696	1.41%
Turkcell	15000	9.97	86116	15000	9.03	72836	0.97%
Haci Omer Sabanci Holding	16888	9.35	90926	16888	8.76	79551	1.06%
KOC HOLDING	34755	12.90	258170	34755	12.45	232676	3.11%
iŞ BANKASI (C)	33800	5.02	97706	33800	4.82	87605	1.17%

T. GARANTI BANKASI	42500	8.41	205819	42500	7.29	166602	2.23%
EREĖLI DEMİR CELİK /EREGL	62000	4.20	149948	62000	4.71	157028	2.10%
Arcelik /ARCLK.E	21000	20.44	247172	21000	20.04	226298	3.03%
ADANA CIMENTO C	219360	0.81	102316	219360	0.80	94365	1.26%
ADANA CIMENTO A	21000	6.23	75337	21000	5.90	66625	0.89%
Общо			2122494			1895345	25.34%
АКЦИИ СЛОВЕНИЯ							
KRKA DD	5475	58.50	626428	5475	50.00	535408	7.16%
ZAVAROVALNICA TRIGLAV	4483	23.11	202628	4483	23.10	202540	2.71%
Общо			829056			737949	9.86%
ISHARES JPM EMERG BOND	1400	103.96	284659	1400	102.39	280360	3.75%
Общо:			7235694			6897194	92.20%

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:

09.12.2016 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.