

ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ ГЛОБАЛ ЕТФС “

01.02.2022 г. - 28.02.2022 г.

Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на февруари нетните активи на фонда са 6 481 893.51 лв., което представлява намаление от 35 960.18 лв. спрямо края на месец януари. Броят на емитираните дялове остава без промяна на 24 964.0828 броя.

Представяне на индексите на развиващите се пазари в евро

MSCI Index	MTD	3MTD	YTD	1 Yr	3 Yr	5 Yr	10 Yr
Китай	-4.1%	-9.5%	-5.6%	-26.8%	-0.7%	2.7%	4.1%
Индия	-4.3%	-1.8%	-4.3%	24.5%	14.0%	8.9%	8.0%
Индонезия	5.3%	7.4%	7.3%	16.2%	-0.3%	0.2%	1.0%
Корея	0.3%	-4.5%	-8.6%	-12.9%	6.2%	4.2%	4.7%
Малайзия	5.1%	5.8%	2.8%	2.4%	-5.4%	-3.0%	-2.8%
Филипини	-0.2%	2.0%	5.4%	14.1%	-0.4%	-1.1%	4.5%
Тайван	-2.7%	0.8%	-3.3%	14.4%	26.5%	14.9%	11.6%
Тайланд	4.7%	12.2%	6.5%	7.4%	-4.8%	0.3%	2.2%
Бразилия	14.5%	17.1%	14.5%	1.6%	-10.2%	-3.3%	-5.3%
Чили	14.1%	11.4%	14.1%	-1.2%	-14.7%	-7.1%	-6.3%
Колумбия	12.2%	7.4%	12.2%	17.9%	-6.4%	-3.7%	-6.4%
Мексико	-3.9%	3.1%	-3.9%	28.2%	3.1%	0.8%	0.0%
Перу	13.4%	11.8%	13.4%	1.5%	-8.7%	-1.2%	0.2%
Латинска Америка	4.5%	17.7%	13.8%	16.8%	-4.9%	-2.7%	-3.9%
Чехия	-3.1%	9.6%	-1.8%	48.8%	8.7%	7.7%	-0.8%
Унгария	-26.5%	-21.8%	-18.5%	-6.9%	-4.0%	1.3%	3.5%
Полша	-12.1%	-9.3%	-13.5%	2.4%	-9.7%	-4.8%	-3.1%
Русия	-52.8%	-58.4%	-56.5%	-47.2%	-19.6%	-11.4%	-8.4%
Турция	-1.4%	7.5%	5.6%	-17.7%	-14.8%	-14.6%	-8.9%
Египет	-5.7%	-7.3%	-8.4%	-2.7%	-4.5%	-5.5%	-1.2%
Южна Африка	4.5%	16.6%	13.1%	15.3%	2.9%	0.2%	0.4%
Развиваща се Азия	-2.6%	-4.4%	-4.7%	-9.6%	6.3%	5.3%	5.4%
Развиващи се пазари	-3.3%	-3.2%	-3.7%	-5.5%	4.2%	3.4%	2.6%

Към 28.02.2022 г.

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.

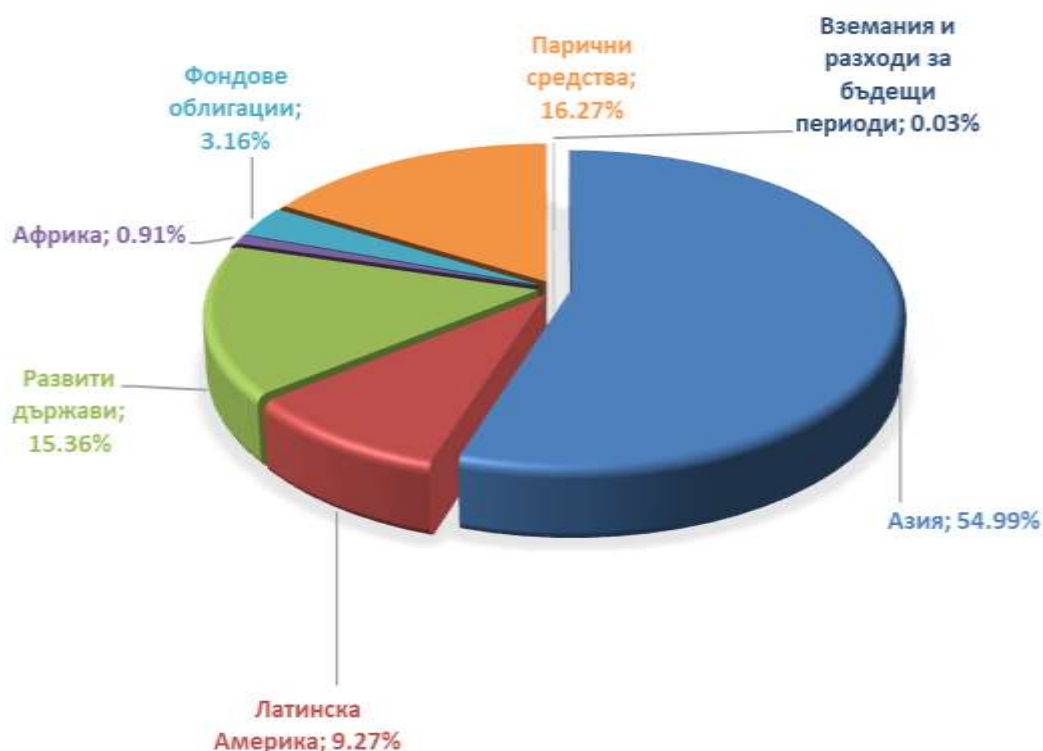
Светът се промени за няколко дни. Или може би по-точно на повърхността излезе таено от години противостоене между геополитически сили. Противостоене още от годините на Втората световна война, през това от Студената война, Перестройката, та до днес. През цялото това време военните сили от двете страни 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 пазарите (с изключение на рублата) 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. Според мен акциите, заедно с долара, златото и крипто активите са убежище за голямото количество застрашен капитал. Затова смятам, че значителни пропадания на тези пазари в следствие на моментен страх са възможност за пласиране на допълнителна експозиция.



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

Активи	31.12.2021	31.01.2022	28.02.2022	Структура на активите спрямо общата им стойност [%]
Дялове в КИС, акции и права	5 710 214	5 462 667	5 436 763	83.70%
Облигации	0	0	0	0.00%
Парични средства	982 998	1 065 203	1 057 141	16.27%
Депозити до 3 мес.	0	0	0	0.00%
Вземания	1 064	3 122	0	0.00%
Други	0	2178	1995	0.03%
Общо:	6 694 277	6 533 170	6 495 900	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.

Движение на ДФ Скай Глобал ETFs спрямо MSCI EM и BRIC


Доходност на ДФ Скай Глобал ETFs спрямо MSCI EM

	Q2 2020	Q3 2020	Q4 2020	Q1 2021	Q2 2021	Q3 2021	Q4 2021	Януари 2022	Февруари 2022
Доходност MSCI EM	14.60%	4.10%	14.40%	6.1%	3.50%	-6.72%	0.20%	-0.51%	-3.25%
Доходност ДФ Скай Глобал ETFs	14.72%	2.90%	14.30%	7.29%	3.60%	-2.24%	3.45%	-2.04%	-0.55%
Стандартно отклонение* на ДФ Скай Глобал ETFs									8.49%

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

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

Company	31.01.2022				28.02.2022			
	Брой ценни книжа	Цена за брой ¹	Балансова стойност в лв	Процент от активите	Брой ценни книжа	Цена за брой ¹	Балансова стойност в лв	Процент от активите
LYXOR MSCI ASIA PACIFIC	1524	65.05	193893.55	2.97%	1524	64.12	191121.52	2.94%
LYXOR MSCI KOREA-C-EUR	608	66.97	79637.02	1.22%	608	66.7	79315.95	1.22%
LYXOR MSCI BRAZIL UCITS ETF	3000	16.552	97118.69	1.49%	3000	17.102	100345.81	1.54%
LYXOR MSCI TAIWAN	5800	24.705	280248.92	4.29%	5800	24.73	280532.52	4.32%
AMUNDI ETF MSCI INDIA UCITS ETF - EUR	260	752.2	382505.58	5.85%	260	721.5	366894.15	5.65%
LYXOR INTL PAN AFRICA UCITS C EUR	3000	9.733	57108.28	0.87%	3000	10.074	59109.09	0.91%
AMUNDI FUNDS ASIA EQUITY CONCENTRATED - A2 USD	4000	37.89	265708.93	4.07%	4000	36.51	255048.64	3.93%
DB X-TRACKERS MSCI SINGAPORE UCITS ETF	53000	1.3234	137182.31	2.10%	53000	1.3272	137576.21	2.12%
XTRACKERS MSCI PHILIPPINES UCITS ETF	25600	1.6424	82233.73	1.26%	25600	1.6506	82644.3	1.27%

¹ Цена в оригинална валута

MULTI UNITS LUXEMBOURG-LYXOR ETF AUSTRALIA (S&P ASX 200)	2500	45.06	220324.25	3.37%	2500	47.755	233501.65	3.59%
XTRACKERS MSCI INDONESIA SWAP UCITS ETF	5499	13.408	144204.5	2.21%	5499	14.032	150915.7	2.32%
XTRACKERS MSCI MEXICO UCITS ETF	21565	4.46	188111.53	2.88%	21565	4.637	195576.96	3.01%
UBS ETF - MSCI PACIFIC (EX JAPAN) UCITS ETF (USD) A- DIS	2200	38.795	166928.13	2.56%	2200	39.995	172091.53	2.65%
DB X-TRACKERS FTSE VIETNAM ETF	845	40.16	66371.48	1.02%	845	39.095	64611.39	0.99%
XTRACKERS MSCI TAIWAN UCITS ETF	3833	52.18	391177.62	5.99%	3833	51.37	385105.29	5.93%
XTRACKERS MSCI KOREA UCITS ETF	1301	76.72	195216.71	2.99%	1301	76.26	194046.23	2.99%
FIDELITY FUNDS- INDONESIA FUND A (USD)	1500	25.7	67584.32	1.03%	1500	26.88	70416.06	1.08%
ISHARES MSCI MEXICO CAPPED UCITS ETF USD	550	108.8	117036.87	1.79%	550	113.16	121726.95	1.87%
iSHARES MSCI CANADA B	1307	161.4	412581.95	6.32%	1307	162.44	415240.47	6.39%
ISHARES MSCI AC FAR EAST EX-JAPAN SMALL CAP	1100	25.905	67023.98	1.03%	1100	26.175	67400.65	1.04%
ISHARES JPM EMERG BOND	1200	93.158	218641.45	3.35%	1200	87.414	205160.31	3.16%
ISHARES MSCI EM LATIN AMERICA UCITS ETF	6800	13.458	178986.61	2.74%	6800	13.894	184785.25	2.84%
ISHARES MSCI AC FAR EAST XJP	1720	54.76	184214.15	2.82%	1720	53.22	179033.55	2.76%
ISHARES MSCI TAIWAN	3200	75.8	474406.12	7.26%	3200	74.53	466457.63	7.18%
ISHARES MSCI KOREA	3562	45.835	319317.16	4.89%	3562	45.65	318028.32	4.90%
LYXOR ETF MSCI INDIA	2480	23.905	115950.21	1.77%	2480	22.895	111051.25	1.71%

ISHARES STOXX EUROPE 600 AUTOMOBILES & PARTS UCITS ETF	1300	60.85	154715.93	2.37%	1300	57.58	146401.7	2.25%
ISHARES NIKKEI 225	5000	20.885	204237.55	3.13%	5000	20.72	202623.99	3.12%
			5 462 667.53	83.61%			5 436 763.07	83.70%

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 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.