

ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ НОВИ АКЦИИ”

01.1.2016 г. - 31.1.2016 г.

Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на месец януари нетните активи на фонда са 7 401 153.40 лв., което представлява намаление от -305 368.5492 лв. спрямо края на месец декември.

Броят на емитираните дялове намалява с -3 455.5026 и достига 11 370 813.7152.

Изменение на индексите и разпределение на портфейла по държави

| Изменение | Q4 2014 | Q1 2015 | Q2 2015 | Q3 2015 | Q4 2015 | Януари 2016 |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|------------------|
| SOFIX | -3.2% | -1.5% | -5.6% | -8.7% | 4.03% | -2.78% |
| CROBEX | -9.0% | -1.9% | 1.4% | -3.0% | 0.24% | -4.58% |
| BELEX 15 | 0.9% | -0.1% | -3.1% | -2.7% | 2.51% | -6.59% |
| BET-XT | -1.7% | 0.4% | 3.1% | -3.3% | 0.17% | -9.95% |
| ISE 100 | 14.4% | -5.7% | 1.7% | -7.7% | -5.51% | 1.95% |
| DFNEW | 0.262% | -2,04% | -1.7% | -7% | -1.04% | -3.93% |
| Средно аритметично за индексите | -3.2% | -1.75% | -0.48% | -5.1% | 0.29% | -4.39% |
| Дял на съответната държава от активите на фонда | 31.12.2014 | 31.03.2015 | 30.06.2015 | 30.09.2015 | 31.12.2015 | 31.1.2016 |
| България | 14.28% | 14.87% | 14.13% | 13.83% | 14.07% | 14.29% |
| Хърватска | 4.82% | 4.31% | 4.18% | 4.53% | 4.70% | 4.74% |
| Сърбия | 2.90% | 3.10% | 3.11% | 3.61% | 4.11% | 4.06% |
| Румъния | 26.65% | 25.68% | 26.08% | 28.83% | 28.70% | 26.89% |
| Турция | 25.49% | 29.07% | 29.38% | 27.15% | 26.67% | 28.06% |
| Словения | 7.88% | 7.21% | 7.64% | 10.68% | 11.71% | 11.78% |
| Други | | | | 3.30% | 3.43% | 3.59% |

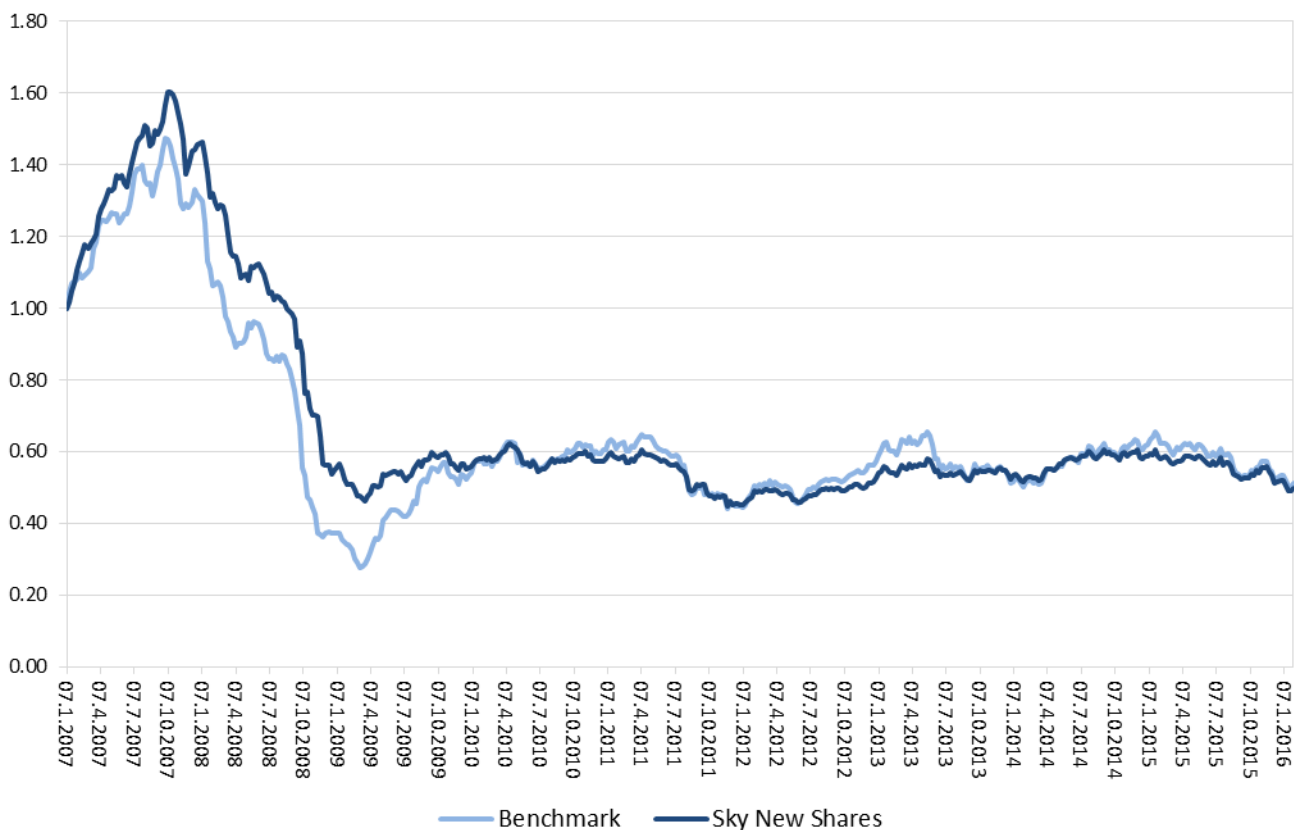
Информация за паричните средства

Към 31.1.2016 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 | 10.22% | -10.47% | -18.05% |
| CROBEX | 7.83% | -3.20% | -5.83% |
| BELEX 15 | 15.39% | -9.43% | 4.85% |
| BET-XT | 12.92% | 0.34% | 6.69% |
| ISE 100 | 21.92% | -16.33% | 5.79% |
| Служебен бенчмарк | 11.81% | -7.82% | -1.31% |
| DFNEW | 11.76% | -15.00% | -3.50% |

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


Януари продължи да носи сериозна волатилност на пазарите. Основните източници на напрежение продължиха да бъдат пазарите на ресурси. Цената на петрола спадна дори под нивата от 2008 г., индустриалните метали също записаха едни от най-ниските си стойности за последното десетилетие. На пръв поглед това са по-скоро положителни новини за световната икономика. Дават възможност за един трансфер на богатство от страните производителки на петрол и ресурси към потребителите. В същото време обаче оказват сериозен натиск върху компаниите добиващи и търгуващи с ресурси. Част от тях имат сериозни нива на дълг в балансите си, като по този начин негативната връзка се прехвърля и върху финансовия сектор. А от там и върху пазарите в цялост. Избягването на риск се прехвърля върху всички активи. Въпреки, че кредитната експозиция към ресурсни компании на повечето значими банки е по-скоро малка, все пак вероятността някоя от тях да бъде засегната по някакъв начин остава. Липсва яснота какво има в балансите им – което е нормално – банките по принцип рядко разкриват индивидуални позиции. А това създава несигурност на пазарите на акции, и както се случва обикновено – при нарастваща несигурност - пазарите падат.

Представяне на фонда за последната година - по месеци

| Доходност по месеци | Средно аритметично за индексите | DFNEW |
|---------------------|---------------------------------|--------|
| Януари 2015 | 0.06% | 0.18% |
| Февруари 2015 | -1.63% | -1.19% |
| Март 2015 | -0.10% | -1.04% |
| Април 2015 | 2.93% | 1.91% |
| Май 2015 | -1.18% | -0.90% |
| Юни 2015 | -2.09% | -2.68% |
| Юли 2015 | 0.88% | 0.88% |
| Август 2015 | -4.39% | -5.97% |
| Септември 2015 | -1.55% | -1.93% |
| Октомври 2015 | 1.76% | 3.30% |
| Ноември 2015 | -2.34% | -0.28% |
| Декември 2015 | 0.97% | -3.93% |
| Януари 2016 | -4.39% | -3.93% |

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

| Активи | 31.10.2015 | 30.11.2015 | 31.12.2015 | 31.1.2016 | Структура на активите спрямо общата им стойност /%/ |
|---------------------------|------------|------------|------------|-----------|---|
| Акции и права и КИС | 7 217 124 | 7 498 328 | 7 527 078 | 6 933 670 | 93.40% |
| Облигации | - | - | - | - | |
| Парични средства | 628 411 | 537 997 | 518 300 | 487 687 | 6.57% |
| Депозити до 3 мес. | 0 | 0 | 0 | 0 | 0.00% |
| Вземания | 5 731 | 47 414 | 0 | 0 | 0.00% |
| Разходи за бъдещи периоди | 518 | 345 | 176 | 1 876 | 0.03% |
| Общо: | 7 851 784 | 8 084 084 | 8 045 554 | 7 423 233 | 100.00% |

Стойност на притежаваните от ДФ “СКАЙ Нови Акции” акции

| Дружество | 31.12.2015 | | | 31.1.2016 | | | |
|--------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------|---------------------|
| | 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 | | | | | | | |
| София Комерс - заложни къщи АД | 4812 | 4.79 | 23049 | 4812 | 4.49 | 21606 | 0.29% |
| Софарма АД - София | 81992 | 2.72 | 223018 | 81992 | 2.64 | 216131 | 2.91% |
| М и С ХИДРАВЛИК АД | 11490 | 5.15 | 59151 | 11490 | 4.99 | 57289 | 0.77% |
| ЗЪРНЕНИ ХРАНИ БЪЛГАРИЯ АД | 9766 | 0.37 | 3613 | 9766 | 0.33 | 3233 | 0.04% |
| ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ | 282929 | 0.30 | 84879 | 282929 | 0.32 | 90537 | 1.22% |
| Монбат АД | 20000 | 8.00 | 159960 | 20000 | 7.35 | 147000 | 1.98% |
| Албена инвест холдинг | 5317 | 6.35 | 33758 | 5317 | 6.01 | 31960 | 0.43% |
| Химимпорт АД | 42568 | 1.34 | 56956 | 42568 | 1.31 | 55594 | 0.75% |
| СИРМА ГРУП ХОЛДИНГ АД | 33333 | 1.20 | 40033 | 33333 | 1.16 | 38800 | 0.52% |

¹ Цени в съответната валута

| | | | | | | | |
|--|---------|---------|---------|---------|---------|---------|--------|
| ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ | 149450 | 0.00 | 149 | 149450 | 0.00 | 149 | 0.00% |
| ЧЕЗ РАЗПРЕДЕЛЕНИЕ БЪЛГАРИЯ АД | 600 | 126.00 | 75600 | 600 | 131.00 | 78600 | 1.06% |
| Индустриален Холдинг България АД | 23333 | 0.92 | 21466 | 23333 | 0.86 | 20066 | 0.27% |
| ИД Елана високодоходен фонд | 3316 | 92.05 | 305233 | 3316 | 90.33 | 299539 | 4.04% |
| Общо: | | | 1086866 | | | 1060504 | 14.29% |
| АКЦИИ ХЪРВАТСКА | | | | | | | |
| KONCHAR ELECTROINDUSTRIJA D.D. | 844 | 667.98 | 144382 | 844 | 647.99 | 139641 | 1.88% |
| KONCHAR TRANSFORMATORI | 412 | 1250.00 | 131891 | 412 | 1260.00 | 132547 | 1.79% |
| Duro Dakovic holding | 1000 | 26.89 | 6887 | 1000 | 33.11 | 8454 | 0.11% |
| Atlanska Plovitba D.D. DUBROVNIK | 730 | 146.00 | 27295 | 730 | 117.79 | 21955 | 0.30% |
| Adris P-A | 560 | 365.00 | 52347 | 560 | 345.00 | 49330 | 0.66% |
| Общо: | | | 362801 | | | 351927 | 4.74% |
| АКЦИИ РУМЪНИЯ | | | | | | | |
| CNTEE TRANSELECTRICA SA | 29275 | 29.15 | 368474 | 29275 | 27.60 | 348451 | 4.69% |
| TRANSGAZ SA MEDIAS | 900 | 277.00 | 107645 | 900 | 260.00 | 100914 | 1.36% |
| Petrom Bucuresti | 3000000 | 0.29 | 375656 | 3000000 | 0.25 | 320854 | 4.32% |
| S.N.G.N. ROMGAZ S.A. | 5000 | 27.20 | 58723 | 5000 | 23.70 | 51104 | 0.69% |
| SIF OLTENIA CRAIOVA | 335000 | 1.69 | 244457 | 335000 | 1.56 | 225374 | 3.04% |
| SIF Transilvania /SIF 3/ | 400000 | 0.27 | 47238 | 400000 | 0.27 | 46834 | 0.63% |
| SIF MOLDOVA BACAU | 468000 | 0.79 | 158833 | 468000 | 0.70 | 141481 | 1.91% |
| SIF Banat Crisana /SIF 1/ | 250000 | 1.69 | 182215 | 250000 | 1.54 | 165818 | 2.23% |
| SNO - Santierul Naval Orsova | 17700 | 3.03 | 23157 | 17700 | 2.45 | 18701 | 0.25% |

| | | | | | | | |
|--|---------|----------|---------|---------|----------|---------|--------|
| Farmaceutica Remedia SA | 104000 | 0.20 | 9161 | 104000 | 0.20 | 9060 | 0.12% |
| SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/ | 1466649 | 0.81 | 512959 | 1466649 | 0.73 | 461726 | 6.22% |
| BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti | 24420 | 12.10 | 127586 | 24420 | 10.04 | 105734 | 1.42% |
| ОБЩО | | | 2216105 | | | 1996052 | 26.89% |
| АКЦИИ СЪРБИЯ | | | | | | | |
| Veterinarski zavod AD | 3017 | 500.00 | 24258 | 3017 | 430.00 | 20587 | 0.28% |
| Novosadski sajam a.d. Novi Sad | 1745 | 430.00 | 12066 | 1745 | 550.00 | 15230 | 0.21% |
| NIS AD NOVI SAD | 3881 | 600.00 | 37445 | 3881 | 561.00 | 34551 | 0.47% |
| RTC LUKA LEGET A.D. | 223 | 3098.39 | 11111 | 223 | 3098.39 | 10965 | 0.15% |
| KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD | 210 | 1624.00 | 5484 | 210 | 1570.00 | 5232 | 0.07% |
| ALFA PLAM a.d. Vranje | 266 | 33930.00 | 145134 | 266 | 31741.00 | 133984 | 1.80% |
| AIK BANKA a.d. Niš | 2774 | 1838.00 | 81989 | 2774 | 1830.00 | 80558 | 1.09% |
| Agrobanka a.d. Beograd | 132 | 0.01 | 0 | 132 | 0.01 | 0 | 0.00% |
| Общо | | | 317488 | | | 301106 | 4.06% |
| АКЦИИ ТУРЦИЯ | | | | | | | |
| TURK TRAKTOR | 6500 | 69.55 | 277721 | 6500 | 72.55 | 284975 | 3.84% |
| TAV HAVALIMANLARI | 33000 | 18.19 | 368761 | 33000 | 17.50 | 348986 | 4.70% |
| MIGROS | 6000 | 17.45 | 64320 | 6000 | 15.97 | 57904 | 0.78% |
| Enka Insaat Ve Sanayi AS | 24885 | 4.52 | 69100 | 24885 | 4.39 | 66017 | 0.89% |
| YAPI VE KREDI BANKASI | 63000 | 3.29 | 127331 | 63000 | 3.71 | 141244 | 1.90% |
| Turkcell | 15000 | 9.90 | 91227 | 15000 | 10.52 | 95359 | 1.28% |
| Haci Omer Sabanci Holding | 16888 | 8.28 | 85903 | 16888 | 8.55 | 87257 | 1.18% |
| KOC HOLDING | 34755 | 10.93 | 233365 | 34755 | 11.82 | 248251 | 3.34% |
| İŞ BANKASI (C) | 33800 | 4.60 | 95515 | 33800 | 4.62 | 94366 | 1.27% |

| | | | | | | | |
|---------------------------|--------|-------|---------|--------|-------|---------|--------|
| T. GARANTI BANKASI | 42500 | 7.12 | 185895 | 42500 | 7.43 | 190824 | 2.57% |
| EREĞLİ DEMİR ÇELİK /EREGL | 62000 | 3.04 | 115788 | 62000 | 3.09 | 115773 | 1.56% |
| Arcelik /ARCLK.E | 21000 | 13.97 | 180225 | 21000 | 15.41 | 195559 | 2.63% |
| ADANA CIMENTO C | 219360 | 0.63 | 84898 | 219360 | 0.62 | 82187 | 1.11% |
| ADANA CIMENTO A | 21000 | 6.16 | 79469 | 21000 | 5.88 | 74619 | 1.01% |
| Общо | | | 2059520 | | | 2083320 | 28.06% |
| KRKA DD | 5475 | 65.20 | 698173 | 5475 | 62.00 | 663906 | 8.94% |
| ZAVAROVALNICA TRIGLAV | 4483 | 23.50 | 206048 | 4483 | 24.00 | 210432 | 2.83% |
| Общо | | | 904220 | | | 874338 | 11.78% |
| ISHARES JPM EMERG BOND | 1400 | 96.70 | 264780 | 1400 | 97.30 | 266423 | 3.59% |
| Общо: | | | 7211780 | | | 6933670 | 93.40% |

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:

08.2.2016 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.