

ИНФОРМАЦИЯ

СЪГЛАСНО ИЗИСКВАНИЯТА НА ЧЛ. 72, АЛ. 2 ОТ НАРЕДБА № 44,

ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ НОВИ АКЦИИ”
(ПРЕДИШНО НАИМЕНОВАНИЕ СТАТУС НОВИ АКЦИИ)

ИЗГОТВЕНА ОТ УД „СКАЙ УПРАВЛЕНИЕ НА АКТИВИ” АД

ЗА ПЕРИОДА ОТ 01.2.2014 Г. ДО 28.2.2014 Г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

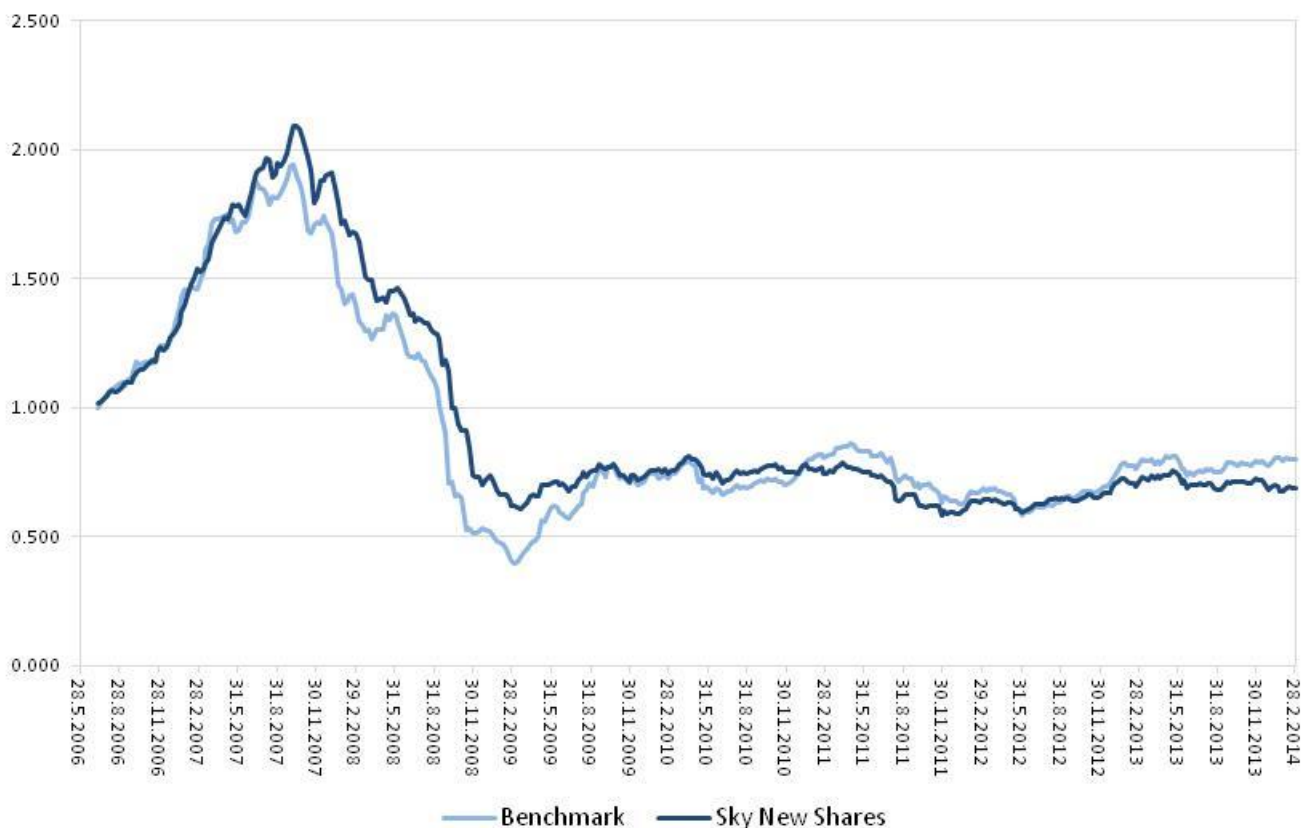
Към края на месец февруари нетните активи на фонда са 6792460.69 лв., което представлява увеличение от 590 577.80 лв. спрямо края на месец януари. Броят на емитираните дялове се увеличава с 713 932.0065 и достига 9908833.58.

Изменение	Q1 2013	Q2 2013	Q3 2013	Q4 2013	Януари 2014	Февруари 2014
SOFIX	11.24%	15.5%	2.8%	7.7%	11.25%	8.70%
CROBEX	15.37%	-10.1%	0.3%	-0.9%	0.52%	-0.47%
BELEX 15	10.31%	-16.9%	9.3%	6.3%	2.84%	-1.01%
BET-C	9.03%	-7.1%	12.6%	5.2%	-1.40%	-0.87%
ISE 100	9.83%	-11.2%	-2.4%	-9.0%	-8.77%	1.12%
DFNEW	7.00%	-4.6%	0.27%	-0.61%	-3.31%	1.63%
Средно аритметично за индексите	11.16%	-5.97%	4.55%	1.88%	0.89%	1.50%
Дял на съответната държава от активите на фонда	31.03.2013	30.06.2013	30.09.2013	31.12.2013	31.01.2014	28.02.2014
България	21.47%	19.06%	21.84%	22.54%	23.85%	22.01%
Хърватска	6.40%	5.41%	5.12%	5.35%	5.55%	5.01%
Сърбия и Македония	3.68%	3.01%	3.33%	3.71%	3.96%	3.48%
Румъния	24.23%	20.46%	22.89%	29.79%	29.77%	27.29%
Турция	32.95%	26.97%	26.17%	27.24%	24.95%	23.09%

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

Индекс	Стандартно отклонение	Изменение 12 месеца	Изменение 24 месеца
SOFIX	11.23%	55.59%	89.62%
CROBEX	6.92%	-7.73%	0.44%
BELEX 15	11.11%	-0.39%	3.49%
BET-C	9.70%	5.75%	5.33%
ISE 100	28.96%	-21.15%	3.02%
Служебен бенчмарк	13.03%	6.42%	20.38%
DFNEW	11.65%	-3.33%	7.21%

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

Движение на цената на фонда спрямо служебния бенчмарк в лева


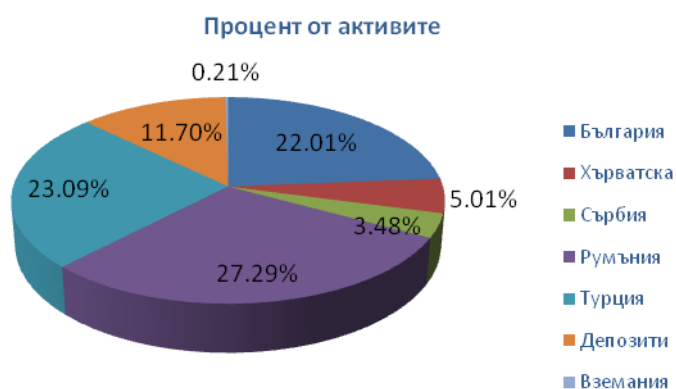
През февруари натиска върху валутите и пазарите от така наречените „Крепки пет” – Индия, Индонезия, Турция, Южна Африка и Бразилия намаля, след като и Турция повиши лихвите си в края на януари. Като Индонезия и Южна Африка се оказаха между най-поскъпващите основни развиващи се пазари през месеца. На хоризонта обаче се появи друга криза – тази в Украйна. Въпреки че икономиката на Украйна е сравнително малка и слабо интегрирана в световните финанси, участието на Русия в този конфликт променя значително мащаба му. Евентуална ескалация на напрежението и вероятността от налагане на търговски или икономически санкции срещу Русия, прави възможно пренасяне и на икономически проблеми върху икономиките на държавите от ЕС и особено върху тези, които са силно зависими от руски газ или разчитат на руски пазари.

В същото време евентуално увеличение на военната кампания на Русия, която за момента е ограничена само до Крим, прави възможни, макар и към момента доста слабо вероятни значителни негативни последици.

Доходност по месеци	Средно аритметично за индексите	DFNEW
Февруари 2013	0.82%	0.45%
Март 2013	2.34%	3.86%
Април 2013	-1.07%	-0.22%
Май 2013	-0.75%	-0.04%
Юни 2013	-4.58%	-4.32%
Юли 2013	1.88%	-0.54%
Август 2013	-0.86%	-2.42%
Септември 2013	3.66%	3.31%
Октомври 2013	0.23%	1.46%
Ноември 2013	1.66%	1.31%
Декември 2013	0.00%	-3.31%
Януари 2014	0.89%	-3.71%
Февруари 2014	1.50%	1.63%

Обща промяна на петте индекса при база 28/05/2006



Обем и структура на инвестициите в портфейла

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

Активи	30.11.2013	31.12.2013	31.1.2014	28.2.2014	Структура на активите спрямо общата им стойност [%]
Акции и права и КИС	5 907 940	5 719 146	5 478 498	5 509 650	80.88%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	226 283	217 317	221 887	1 292 947	18.98%
Депозити до 3 мес.	505 482	505 482	505 482	0	0.00%
Вземания	31 337	11 280	12 965	9 366	0.14%
Разходи за бъдещи периоди	184	0	522	478	0.01%
Общо:	6 671 227	6 453 226	6 219 353	6 812 441	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “СКАЙ Нови Акции” акции

Дружество	31.1.2014			28.2.2014			
	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							
ЧЕЗ РАЗПРЕДЕЛЕНИЕ БЪЛГАРИЯ АД	109	1581.00	172329	109	1644.17	179214	2.63%
АЛБЕНА ИНВЕСТ ХОЛДИНГ	5317	6.25	33237	5317	6.57	34911	0.51%
СОФИЯ КОМЕРС - ЗАЛОЖНИ КЪЩИ АД	4812	5.65	27188	4812	5.80	27910	0.41%
СОФАРМА АД - СОФИЯ	81992	3.95	323540	81992	4.45	365110	5.36%
ИНДУСТРИАЛЕН ХОЛДИНГ БЪЛГАРИЯ АД	23333	1.01	23660	23333	1.29	30170	0.44%
М И С ХИДРАВЛИК АД	3830	11.20	42885	3830	13.58	52000	0.76%
Монбат АД	20000	8.07	161380	20000	8.60	172080	2.53%
ТРЕЙС ГРУП ХОЛД АД	6272	4.80	30118	6272	6.28	39363	0.58%
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	282929	0.60	170040	282929	0.61	171172	2.51%
АКТИВ ПРОПЪРТИС АДСИЦ	133940	0.17	23038	104140	0.18	18329	0.27%
ФОНД ЗА НЕДВИЖИМИ ИМОТИ БЪЛГАРИЯ АДСИЦ	140100	0.54	75374				
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.30	45179	149450	0.30	45179	0.66%
ИД ЕЛАНА ВИСОКОДОХОДЕН ФОНД	1475	88.58	130660	1475	92.66	136675	2.01%
ДФ ЕЛАНА ГЛОБАЛЕН ФОНД В АКЦИИ	831	106.96	173814	831	108.54	176386	2.59%
ОББ ПЛАТИНУМ ЕВРО ОБЛИГАЦИИ	251	104.03	51116	251	104.20	51200	0.75%
Общо:			1483558			1499699	22.01%
АКЦИИ ХЪРВАТСКА							
ADRIS P-A	560	274.01	39223	560	263.61	37745	0.55%
ATLANSKA PLOVITVA D.D. DUBROVNIK	230	383.03	22519	230	393.01	23112	0.34%

¹ Цени в съответната валута

DURO DAKOVIC HOLDING	1000	60.90	15567	1000	57.92	14809	0.22%
KONCHAR TRANSFORMATORI	412	1102.01	116056	412	1147.00	120828	1.77%
KONCHAR ELECTROINDUSTRIJA D.D.	844	702.50	151556	844	670.00	144586	2.12%
Общо:			344921			341081	5.01%
АКЦИИ РУМЪНИЯ							
BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE BUCURESTI	24420	8.80	93518	24420	8.75	92832	1.36%
CNTEE TRANSELECTRICA SA	29275	14.84	189060	29275	15.60	198411	2.91%
PETROM BUCURESTI	2200000	0.47	446242	2200000	0.45	433934	6.37%
SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/	1584171	0.82	562205	1584171	0.82	562301	8.25%
SIF BANAT CRISANA /SIF 1/	125000	1.26	68486	125000	1.26	68372	1.00%
SIF MOLDOVA BACAU	234000	1.36	138390	234000	1.38	140294	2.06%
SIF OLTENIA CRAIOVA	335000	1.88	274076	335000	1.95	284099	4.17%
SIF TRANSILVANIA	200000	0.63	55050	200000	0.63	54698	0.80%
FARMACEUTICA REMEDIA SA	104000	0.29	13170	104000	0.31	13781	0.20%
SNO - SANTIERUL NAVAL ORSOVA	17700	1.50	11577	17700	1.34	10304	0.15%
ОБЩО			1851776			1859027	27.29%
АКЦИИ СЪРБИЯ							
AGROBANKA A.D. BEOGRAD	132	0.01	0	132	0.01	0	0.00%
AIK BANKA A.D. NIŠ	2774	1642.00	76849	2774	1479.00	69213	1.02%
ALFA PLAM A.D. VRANJE	266	13300.00	59689	266	13500.00	60580	0.89%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	210	1650.00	5846	210	1700.00	6023	0.09%
RTC LUKA LEGET A.D.	3881	3067.36	58931	3881	932.00	61020	0.90%
NIS AD NOVI SAD	223	900.00	11541	223	3067.36	11539	0.17%
NOVOSADSKI SAJAM A.D. NOVI SAD	1745	330.00	9716	1745	330.00	9715	0.14%

VETERINARSKI ZAVOD AD	3017	470.00	23924	3017	370.00	18832	0.28%
Общо			246495			236922	3.48%
АКЦИИ ТУРЦИЯ							
AK ENERJI SHS	26457	1.00	16832	26457	1.00	16935	0.25%
AKBANK	20666	5.76	75732	20666	5.72	75666	1.11%
ENKA INSAAT VE SANAYI AS	19908	6.44	81567	19908	6.68	85124	1.25%
T. GARANTI BANKASI	82500	5.96	312823	82500	6.06	320018	4.70%
İŞ BANKASI (C)	33800	4.05	87091	33800	4.09	88489	1.30%
KOC HOLDING	34755	7.66	169373	34755	8.18	181978	2.67%
MIGROS	6000	14.60	55732	6000	14.80	56841	0.83%
HACI OMER SABANCI HOLDING	16888	7.47	80260	16888	7.83	84643	1.24%
TAV HAVALIMANLARI	33000	16.95	355863	33000	15.60	329524	4.84%
TURK TRAKTOR	2500	52.00	82707	2500	56.00	89614	1.32%
TURKCELL	15000	11.14	106310	15000	11.52	110609	1.62%
YAPI VE KREDI BANKASI	63000	3.18	127458	63000	3.31	133480	1.96%
Общо			1551748			1572922	23.09%
Общо:			5478498			5509650	80.88%

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:

10.3.2014 г.

Съставил:

Иван Иванов: