

ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ ГЛОБАЛ ЕТФС ”

01.12.2017 г. - 31.12.2017 г.

Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на месец декември нетните активи на фонда са 5 850 863.34 лв., което представлява увеличение от 97 747.1725 лв. спрямо края на месец ноември. Броят на емитираните дялове остава без промяна на 26060.3816.

Представяне на индексите на развиващите се пазари в евро

MSCI Index	MTD	3MTD	YTD	1 Yr	3 Yr	5 Yr	10 Yr
Китай	1.2%	5.9%	32.7%	32.7%	10.5%	9.1%	2.4%
Индия	4.1%	9.9%	20.2%	20.2%	7.5%	9.3%	1.1%
Индонезия	7.8%	6.3%	7.1%	7.1%	3.7%	2.5%	5.1%
Корея	1.2%	8.8%	27.8%	27.8%	13.0%	7.2%	4.4%
Малайзия	5.0%	5.3%	6.4%	6.4%	-4.1%	-2.8%	1.4%
Филипини	4.2%	4.7%	8.3%	8.3%	1.8%	6.3%	7.3%
Тайван	0.5%	2.4%	8.7%	8.7%	7.1%	8.8%	4.6%
Тайланд	4.1%	7.7%	15.0%	15.0%	6.5%	4.4%	8.0%
Бразилия	3.2%	-4.3%	6.3%	6.3%	3.6%	-4.0%	-4.4%
Чили	14.8%	5.3%	22.8%	22.8%	9.0%	-1.5%	3.2%
Колумбия	6.6%	-1.3%	0.0%	0.0%	-7.3%	-12.4%	2.3%
Мексико	-0.8%	-10.0%	-0.3%	-0.3%	-5.0%	-3.8%	0.8%
Перу	0.4%	3.8%	17.3%	17.3%	11.8%	2.8%	5.0%
Латинска Америка	3.3%	-4.5%	6.1%	6.1%	1.5%	-4.0%	-2.4%
Чехия	2.6%	6.1%	13.6%	13.6%	-2.7%	-4.7%	-7.6%
Унгария	4.0%	5.4%	20.2%	20.2%	34.4%	11.1%	-1.6%
Полша	2.8%	4.1%	33.7%	33.7%	3.0%	-0.6%	-4.2%
Русия	1.4%	1.6%	-11.9%	-11.9%	14.6%	-3.9%	-7.1%
Турция	12.2%	2.4%	18.0%	18.0%	-7.0%	-6.0%	-3.7%
Египет	0.3%	-3.6%	-8.2%	-8.2%	-11.6%	0.2%	-5.7%
Южна Африка	8.0%	19.1%	17.0%	17.0%	4.0%	2.7%	3.8%
Развиваща се Азия	1.9%	6.4%	23.0%	23.0%	8.9%	7.6%	3.4%
Развиващи се пазари	2.6%	5.4%	18.0%	18.0%	6.9%	3.8%	1.3%

Към 29.12.2017 г.

Слабата корекция от ноември отшумя през последния месец на годината. Особено добре се представиха развиващите се пазари. От една страна за това допринесе приемането на новите данъчни закони в САЩ, което макар и калкулирано от пазарите като доста вероятно събитие, все пак вкарваше несигурност през ноември. От друга страна данните за световната икономика все повече говорят за ускоряване на синхронизирания икономически растеж в глобален мащаб. Това съчетано с все още доста експанзионистична парична политика на основните централни банки създава положителни емоции на пазарите.

Централните банки и в Европа и в САЩ прилагат доста плавен подход на нормализиране на паричната политика. Доста ниската инфлация, въпреки значителните парични стимули им дава възможност за маневриране и да не избързват със затягането. Това от своя страна задържа доларът на относително ниски равнища и намалява усещането на риск в развиващите се пазари. В същото

време кривата на доходността на държавните облигации стана леко по-стръмна. Т.е. лихвите по дългосрочните облигации леко се покачи през месеца, което пък създаде стимул за покачване на банковите акции. Банките печелят при по-голяма разлика между краткосрочните и дългосрочните лихвени проценти. А финансовият, е най-силно представения в индексите на доста развиващи се пазари.

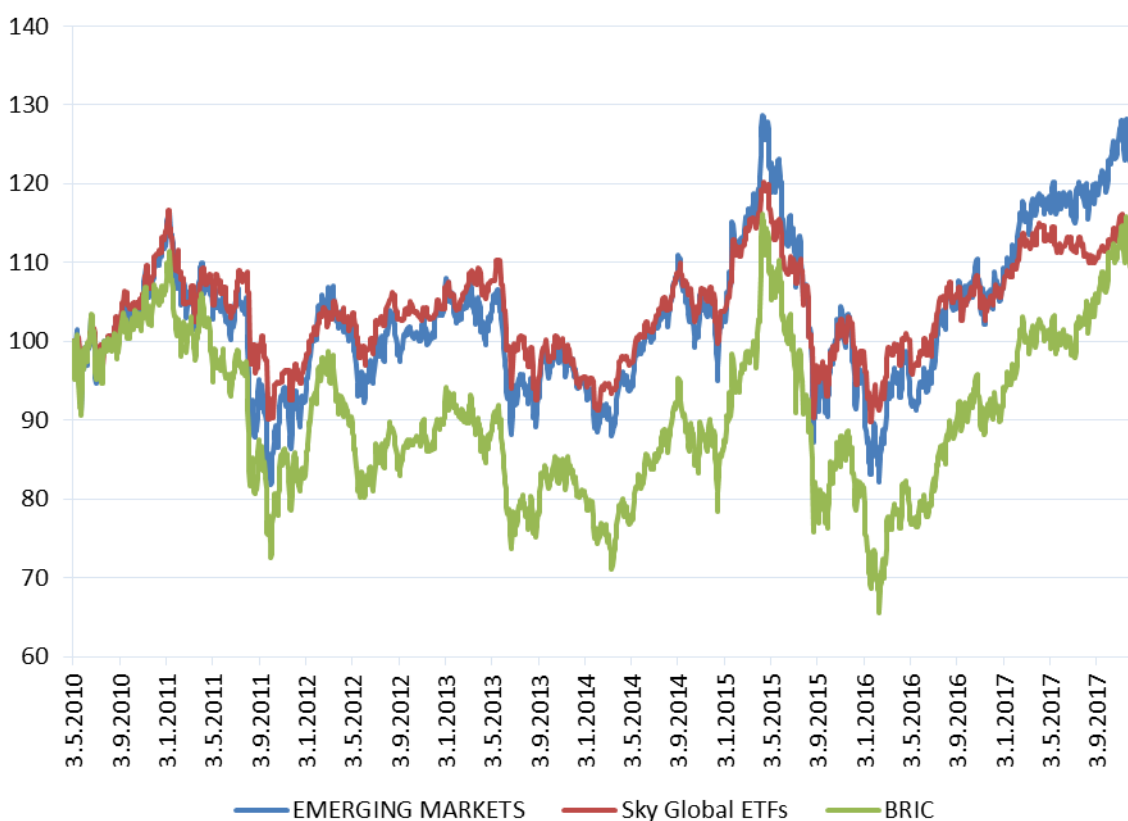

Стойност на портфейла в началото и в края на отчетния период в лева

Активи	31.10.2017	30.11.2017	31.12.2017	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Дялове в КИС, акции и права	5 195 990	5 111 046	5 214 388	88.97%
Облигации	0	0	0	0.0%
Парични средства	658 690	649 041	645 662	11.02%
Депозити до 3 мес.	0	0	0	0.00%
Вземания	858	2 903	1 087	0.02%
Други	345	176	0	0.00%
Общо:	5 855 882	5 763 167	5 861 137	100.0%

Информация за паричните средства

Към 31.12.2017 г. Фонда 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

	Q1 2016	Q2 2016	Q3 2016	Q1 2017	Q2 2017	Q3 2017	Q4 2017	Декември 2017
Доходност MSCI EM	0.45%	2.24%	7.08%	9.6%	-1.1%	3.25%	5.43%	2.63%
Доходност ДФ Скай Глобал ETFs	0.92%	1.88%	4.05%	7.04%	-2.1%	0.31%	2.61%	1.70%
Стандартно отклонение на ДФ Скай Глобал ETFs								8.35%

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

Company	30.11.2017				31.12.2017			
	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 INTL PAN AFRICA UCITS C EUR	3000	9.13	53570.18	0.93%	3000	9.8	57501.4	0.98%
DB X-TRACKERS MSCI SINGAPORE	53000	1.22	126463.97	2.19%	53000	1.223	126774.94	2.16%
DB X-TRACKERS MSCI PHILIPPINES IM TRN INDEX UCITS ETF	25600	1.676	83916.06	1.46%	25600	1.78	89123.26	1.52%
MULTI UNITS LUXEMBOURG-LYXOR ETF AUSTRALIA (S&P ASX)	2500	40.33	197196.56	3.42%	2500	41.25	201694.97	3.44%
DB X-TRACKERS MSCI INDONESIA TRN INDEX ETF	5499	13.08	140676.83	2.44%	5499	13.91	149603.57	2.55%
DB X-TRACKERS MSCI MEXICO	21565	4.074	171831.03	2.98%	21565	3.933	165884.01	2.83%
UBS ETF - MSCI PACIFIC (EX JAPAN) UCITS ETF (USD) A-DIS	2200	37.17	159936.04	2.78%	2200	38.19	164324.92	2.80%
DB X-TRACKERS FTSE VIETNAM ETF	845	25.35	41895.35	0.73%	845	27.38	45250.28	0.77%
AMUNDI FUNDS ASEAN NEW MARKETS-C (USD)	1720.45	97.94	278132.59	4.83%	1720.45	100.37	281610.83	4.80%
DB X-TRACKERS MSCI TAIWAN	3833	23.66	177371.84	3.08%	3833	23.7	177671.7	3.03%
DB X-TRACKERS MSCI KOREA TRN	1301	67.13	170814.62	2.96%	1301	68.11	173308.27	2.96%
AMUNDI FUNDS THAILAND (USD)	1437.028	163.01	386659.96	6.71%	1437.028	169.72	397742.15	6.79%
FIDELITY FUNDS-INDONESIA FUND A (USD)	1500	28.01	69351.22	1.20%	1500	30.01	73410.91	1.25%
ISHARES MSCI MEXICO CAPPED UCITS ETF USD	550	99.24	106753.11	1.85%	550	96.15	103429.18	1.76%
ISHARES MSCI BRAZIL	1100	60.09	129278.41	2.24%	1100	62.67	134829.05	2.30%

¹ Цена в оригинална валута

iSHARES MSCI CANADA B	1307	107.13	273853.18	4.75%	1307	110.82	283285.82	4.83%
ISHARES MSCI AC FAR EAST EX-JAPAN SMALL CAP	1100	26.47	56947.9	0.99%	1100	26.63	57292.13	0.98%
ISHARES MSCI EM LATIN AMERICA UCITS ETF	6800	14.655	194906.28	3.38%	6800	15.155	201556.1	3.44%
ISHARES MSCI AC FAR EAST XJP	1720	48.67	163727.22	2.84%	1720	49.31	165880.2	2.83%
ISHARES MSCI TAIWAN	3823	37.79	282561.05	4.90%	3823	37.88	283233.99	4.83%
ISHARES MSCI KOREA	3562	42.03	292808.99	5.08%	3562	42.76	297894.66	5.08%
AMUNDI ETF MSCI INDIA UCITS ETF - EUR	260	499.73	254120.6	4.41%	260	521.26	265068.95	4.52%
LYXOR ETF MSCI TAIWAN	5800	12.61	143045.49	2.48%	5800	12.64	143385.81	2.45%
LYXOR BRAZIL (IBOVESPA) UCITS ETF	3000	16.4	96226.84	1.67%	3000	17.17	100744.8	1.72%
LYXOR ETF MSCI MALAYSIA	7994	13.87	216856.13	3.76%	7994	14.45	225924.38	3.85%
LYXOR ETF KOREA	608	58.95	70100.08	1.22%	608	60.04	71396.24	1.22%
LYXOR ETF MSCI INDIA	2480	16.02	77704.34	1.35%	2480	16.68	80905.65	1.38%
LYXOR ETF MSCI AC ASIA PACIFIC EX JAPAN	1524	52.32	155949.44	2.71%	1524	53.43	159258	2.72%
ISHARES STOXX EUROPE 600 AUTOMOBILES & PARTS UCITS ETF	1300	58	147469.58	2.56%	1300	58.03	147545.86	2.52%
ISHARES NIKKEI 225	5000	16.995	166196.65	2.88%	5000	16.815	164436.41	2.81%
ISHARES JPM EMERG BOND	1200	95.75	224724.87	3.90%	1200	95.62	224419.76	3.83%
			5 111 046.42	88.68%			5214388.2	88.97%

Репо сделки

През периода не са сключвани договори за репо сделки, както и няма прекратени такива договори; не са закупувани, 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

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:

10.1.2018 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.