

## ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ НОВИ АКЦИИ”

01.5.2016 г. - 31.5.2016 г.

### Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на месец май нетните активи на фонда са 7 478 055.2363 лв., което представлява намаление от -321 694.9506 лв. спрямо края на месец април. Броят на емитираните дялове се намалява с -3 115.9654 и достига 11 304 931.4023.

### Изменение на индексите и разпределение на портфейла по държави

Изменение	Q2 2015	Q3 2015	Q4 2015	Q1 2016	Април 2016	Май 2016
SOFIX	-8.7%	4.03%	-3.2%	-0.24%	-0.84%	-0.28%
CROBEX	-3.0%	0.24%	-1.2%	3.43%	1.13%	0.96%
BELEX 15	-2.7%	2.51%	-5.9%	3.13%	1.89%	-0.87%
BET-XT	-3.3%	0.17%	-4.5%	4.81%	-4.87%	-1.48%
ISE 100	-7.7%	-5.51%	16.1%	9.83%	2.47%	-8.82%
DFNEW	-7%	-1.04%	2.04%	5.20%	-0.22%	-4.10%
Средно аритметично за индексите	-5.1%	0.29%	0.3%	4.19%	-0.04%	-2.10%
<b>Дял на съответната държава от активите на фонда</b>	<b>30.06.2015</b>	<b>30.09.2015</b>	<b>31.12.2015</b>	<b>31.03.2016</b>	<b>30.04.2016</b>	<b>31.05.2016</b>
България	14.13%	13.83%	14.07%	13.41%	13.40%	13.82%
Хърватска	4.18%	4.53%	4.70%	4.73%	4.89%	5.05%
Сърбия	3.11%	3.61%	4.11%	4.18%	4.09%	4.38%
Румъния	26.08%	28.83%	28.70%	26.64%	25.62%	26.21%
Турция	29.38%	27.15%	26.67%	30.64%	31.37%	29.26%
Словения	7.64%	10.68%	11.71%	11.42%	11.33%	11.44%
Други		3.30%	3.43%	3.37%	3.40%	3.60%

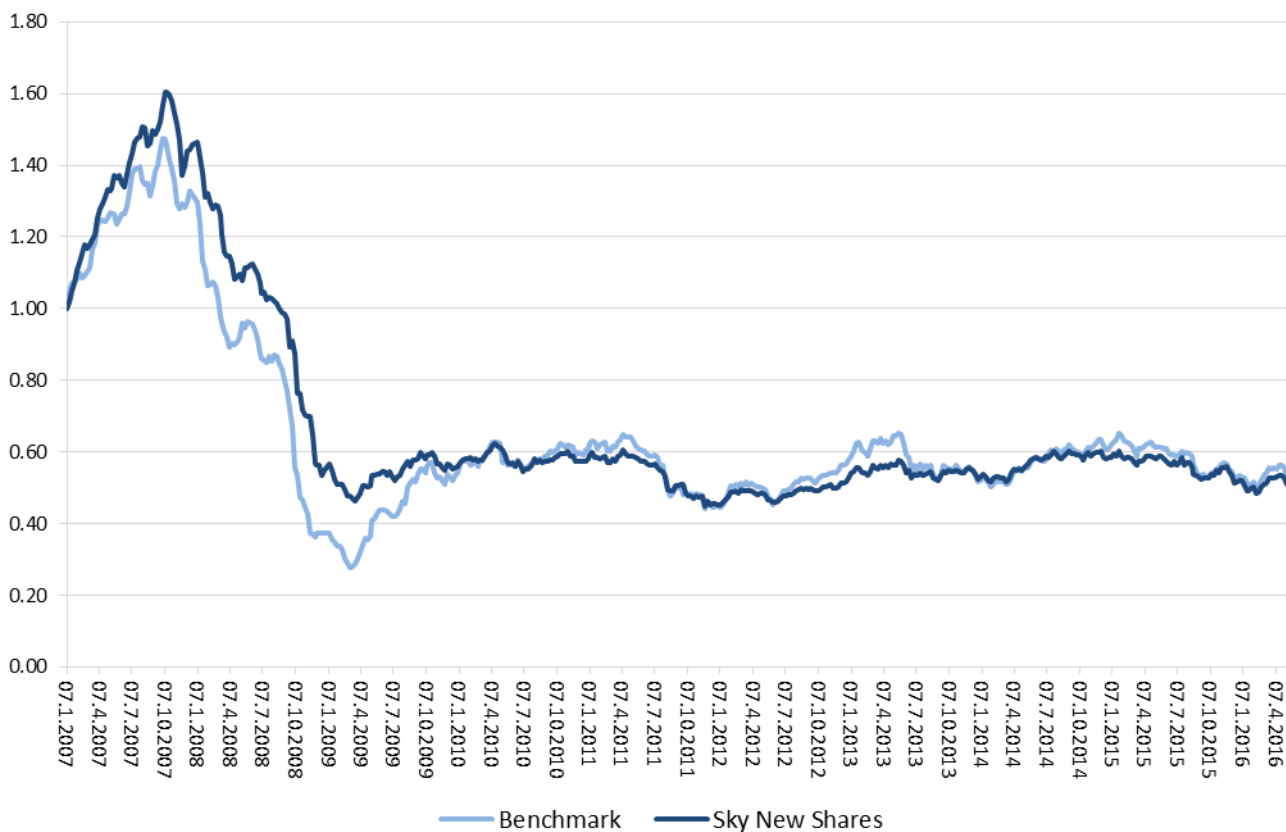
**Информация за паричните средства**

Към 31.5.2016 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	7.79%	-13.6%	4.4%
CROBEX	8.33%	-7.9%	-27.1%
BELEX 15	13.49%	-1.4%	0.2%
BET-XT	13.84%	-6.2%	-1.9%
ISE 100	21.85%	-15.4%	-5.2%
Служебен бенчмарк	12.76%	-8.9%	-5.9%
DFNEW	12.90%	-12.52%	-12.72%

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**


Липсата на посока при развитите пазари продължи и през май. От една страна представянето на повечето компании е по-добро от доста негативните очакванията, които доминираха началото на годината. Но от друга страна макро факторите продължават да натискат пазарите. Редица изявления на управители на ФЕД навяват на мисълта, че на линия е поредно вдигане на лихвите в САЩ. През юни Великобритания ще държи референдум за оставане в ЕС. Тази двойствена природа на относително добри резултати на отделни компании и на макро несигурност водят и до различно представяне на отделни пазари. Тези, при които макро рискът е водещ – както са повечето развиващи се пазари и южна Европа – бяха под натиск, от друга страна американските пазари и северна Европа, които се разглеждат като по-малко повлияни от макро рискове, се представиха по-добре.

#### Представяне на фонда за последната година - по месеци

Доходност по месеци	Средно аритметично за индексите	DFNEW
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%
Февруари 2016	0.50%	0.95%
Март 2016	4.19%	5.20%
Април 2016	-0.04%	-0.22%
Май 2016	-2.10%	-4.10%

#### Обем и структура на инвестициите в портфейла

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

Активи	29.2.2016	31.3.2016	30.4.2016	31.5.2016	Структура на активите спрямо общата им стойност [%]
Акции и права и КИС	7 010 296	7 397 648	7 342 954	7 030 958	93.76%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	459 744	434 298	453 805	464 304	6.19%
Депозити до 3 мес.	0	0	0	0	0.00%
Вземания	9	3 525	4 616	2 228	0.03%
Разходи за бъдещи периоди	1 714	1 540	1 372	1 199	0.02%
Общо:	7 471 762	7 837 011	7 802 748	7 498 688	100.00%

## Стойност на притежаваните от ДФ “СКАЙ Нови Акции” акции

	30.4.2016			31.5.2016			
Дружество	Брой ценни книжа	Цена за брой <sup>1</sup>	Балансова стойност в лв	Брой ценни книжа	Цена за брой <sup>1</sup>	Балансова стойност в лв	Процент от активите
АКЦИИ БЪЛГАРИЯ							
Софарма АД - София	81992	2.70	220968	81992	2.69	220804	2.94%
М и С ХИДРАВЛИК АД	11490	4.99	57324	11490	4.96	56933	0.76%
ЗЪРНЕНИ ХРАНИ БЪЛГАРИЯ АД	9766	0.29	2861	9766	0.28	2715	0.04%
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	282929	0.31	87708	282929	0.31	87708	1.17%
Монбат АД	20000	7.40	147960	20000	7.33	146580	1.95%
София Комерс - заложни къщи АД	4812	3.40	16361	4812	3.56	17111	0.23%
Албена инвест холдинг	5317	6.30	33502	5317	6.75	35879	0.48%
Химимпорт АД	42568	1.11	47336	42568	1.07	45675	0.61%
СИРМА ГРУП ХОЛДИНГ АД	33333	1.04	34600	33333	1.11	37066	0.49%
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.00	149	149450	0.00	149	0.00%
ЧЕЗ РАЗПРЕДЕЛЕНИЕ БЪЛГАРИЯ АД	600	129.54	77725	600	120.04	72024	0.96%
Индустриален Холдинг България АД	23333	0.83	19436	23333	0.80	18666	0.25%
ИД Елана високодоходен фонд	3316	90.38	299697	3316	89.06	295321	3.94%
<b>Общо:</b>			1045628			1036634	13.82%
АКЦИИ ХЪРВАТСКА							
KONCHAR ELECTROINDUSTRIJA D.D.	844	645.00	142342	844	671.07	147907	1.97%
KONCHAR TRANSFORMATORI	412	1349.99	145431	412	1293.97	139219	1.86%
Duro Dakovic holding	1000	42.83	11199	1000	41.15	10746	0.14%
Atlanska Plovitba D.D. DUBROVNIK	730	127.70	24375	730	130.06	24794	0.33%

<sup>1</sup> Цени в съответната валута

Adris P-A	560	395.00	57838	560	381.15	55739	0.74%
Общо:			381185			378406	5.05%
АКЦИИ РУМЪНИЯ							
CNTEE TRANSELECTRICA SA	29275	29.50	377676	29275	30.00	380799	5.08%
TRANSGAZ SA MEDIAS	900	266.00	104695	900	275.00	107313	1.43%
Petrom Bucuresti	3000000	0.23	301751	3000000	0.22	288119	3.84%
S.N.G.N. ROMGAZ S.A.	5000	23.50	51385	5000	23.95	51922	0.69%
SIF OLTENIA CRAIOVA	335000	1.48	216824	335000	1.38	200448	2.67%
SIF Transilvania /SIF 3/	400000	0.26	45044	400000	0.23	40064	0.53%
SIF MOLDOVA BACAU	468000	0.68	138354	468000	0.72	145899	1.95%
SIF Banat Crisana /SIF 1/	250000	1.45	158966	250000	1.46	157826	2.10%
SNO - Santierul Naval Orsova	17700	2.30	17803	17700	2.30	17651	0.24%
Farmaceutica Remedia SA	104000	0.19	8437	104000	0.19	8613	0.11%
SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/	1466649	0.75	479765	1466649	0.74	468038	6.24%
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	24420	9.23	98571	24420	9.35	99000	1.32%
ОБЩО			1999271			1965691	26.21%
АКЦИИ СЪРБИЯ							
Veterinarski zavod AD	3017	370.00	17805	3017	349.00	16729	0.22%
Novosadski sajam a.d. Novi Sad	1745	1050.10	29228	1745	1050.10	29113	0.39%
NIS AD NOVI SAD	3881	610.00	37761	3881	641.00	39525	0.53%
RTC LUKA LEGET A.D.	223	3170.75	11278	223	3170.75	11234	0.15%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	210	1430.00	4790	210	1450.00	4838	0.06%
ALFA PLAM a.d. Vranje	266	33001.00	140017	266	34999.00	147913	1.97%
AIK BANKA a.d. Niš	2774	1770.00	78316	2774	1800.00	79332	1.06%

Agrobanka a.d. Beograd	132	0.01	0	132	0.01	0	0.00%
Общо			319196			328683	4.38%
АКЦИИ ТУРЦИЯ							
TURK TRAKTOR	6500	82.90	329724	6500	81.45	314473	4.19%
TAV HAVALIMANLARI	33000	16.31	329345	33000	15.14	296769	3.96%
MIGROS	6000	19.55	71776	6000	17.09	60908	0.81%
Enka Insaat Ve Sanayi AS	24885	4.86	74004	26129	4.24	65806	0.88%
YAPI VE KREDI BANKASI	63000	4.28	164994	63000	4.13	154550	2.06%
Turkcell	15000	12.10	111061	15000	10.76	95870	1.28%
Haci Omer Sabanci Holding	16888	10.10	104372	16888	9.19	92188	1.23%
KOC HOLDING	34755	14.63	311132	34755	13.11	270644	3.61%
İŞ BANKASI (C)	33800	4.91	101550	33800	4.51	90547	1.21%
T. GARANTI BANKASI	42500	8.62	224171	42500	7.56	190849	2.55%
EREĞLİ DEMİR ÇELİK /EREGL	62000	4.67	177171	62000	4.12	151729	2.02%
Arcelik /ARCLK.E	21000	18.79	241451	21000	19.61	244611	3.26%
ADANA CIMENTO C	219360	0.81	108724	219360	0.68	88602	1.18%
ADANA CIMENTO A	21000	7.66	98431	21000	6.11	76215	1.02%
Общо			2447907			2193762	29.26%
АКЦИИ СЛОВЕНИЯ							
KRKA DD	5475	60.62	649129	5475	58.80	629640	8.40%
ZAVAROVALNICA TRIGLAV	4483	26.80	234982	4483	26.00	227968	3.04%
Общо			884111			857608	11.44%
ISHARES JPM EMERG BOND	1400	97.02	265656	1400	98.67	270174	3.60%
Общо:			7342954			7030958	93.76%

#### 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:

10.6.2016 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.