

ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ НОВИ АКЦИИ”

01.2.2017 г. - 28.2.2017 г.

Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на месец февруари нетните активи на фонда са 8 208 939.08 лв., което представлява увеличение от 211 283.71 лв. спрямо края на месец януари. Броят на емитираните дялове остава без промяна на 11 276 908.4631.

Изменение на индексите в местна валута и разпределение на портфейла по държави

Изменение	Q4 2015	Q1 2016	Q2 2016	Q3 2016	Q4 2016	Февруари 2017
SOFIX	-3.2%	-0.24%	2.06%	10.8%	16.22%	1.47%
CROBEX	-1.2%	3.43%	0.38%	15.8%	2.76%	4.5%
BELEX 15	-5.9%	3.13%	-0.23%	5.2%	12.74%	2.83%
BET-XT	-4.5%	4.81%	-4.07%	7.1%	2.50%	5.2%
ISE 100	16.1%	9.83%	-7.75%	-0.4%	2.16%	1.37%
DFNEW	2.04%	5.20%	-3.82%	5.17%	-2.50%	2.64%
Средно аритметично за индексите	0.3%	4.19%	-1.92%	7.7%	7.27%	3.07%
Дял на съответната държава от активите на фонда	31.12.2015	31.03.2016	30.06.2016	30.09.2016	31.12.2016	28.2.2017
България	14.07%	13.41%	14.12%	16.44%	16.14%	16.42%
Хърватска	4.70%	4.73%	4.91%	5.15%	5.78%	6.43%
Сърбия	4.11%	4.18%	4.09%	2.92%	3.00%	2.89%
Румъния	28.70%	26.64%	26.19%	27.15%	28.08%	29.28%
Турция	26.67%	30.64%	28.97%	26.70%	25.85%	25.30%
Словения	11.71%	11.42%	10.73%	10.87%	9.98%	9.62%
Други	3.43%	3.37%	3.71%	3.57%	3.69%	3.52%

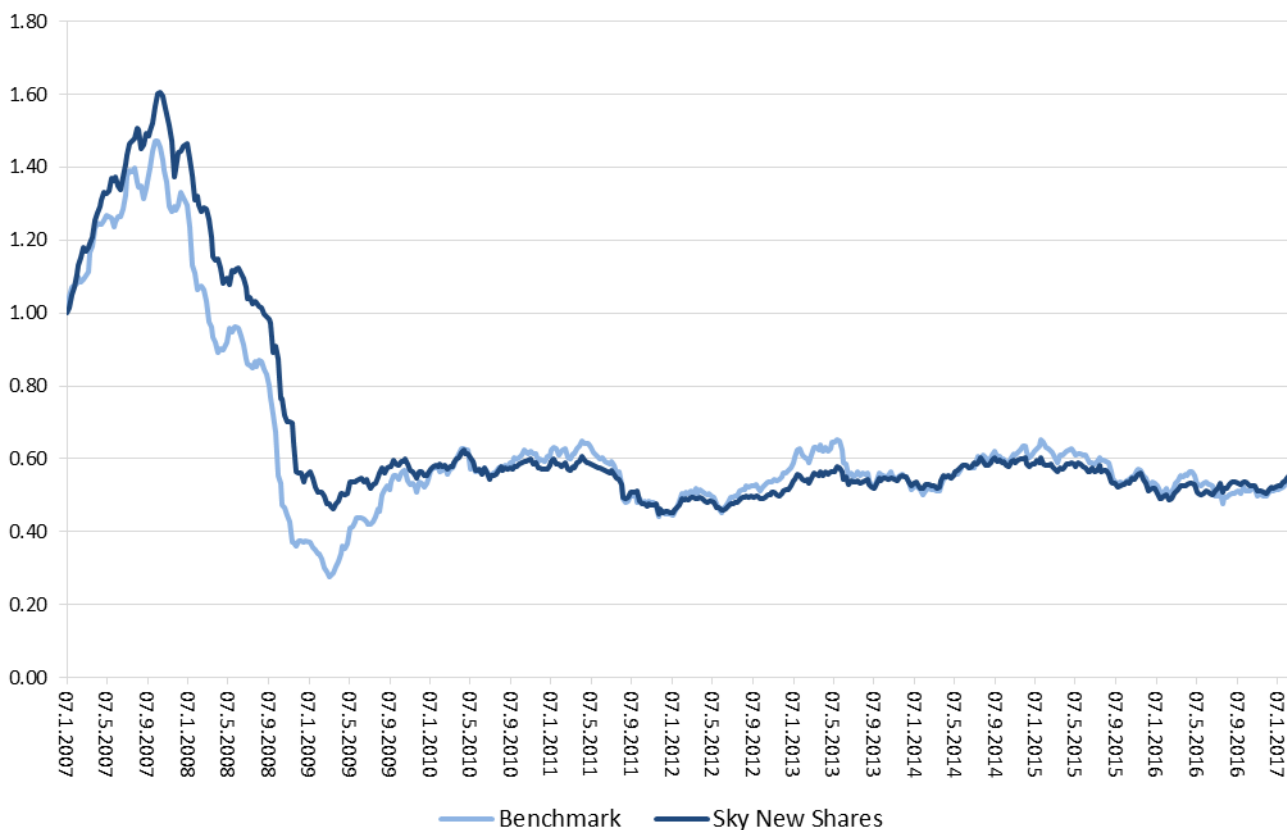
Информация за паричните средства

Към 28.2.2017 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	9.48%	36.59%	25.28%
CROBEX	7.78%	37.59%	27.24%
BELEX 15	10.24%	22.30%	9.23%
BET-XT	9.92%	22.79%	10.22%
ISE 100	24.24%	15.38%	3.96%
Служебен бенчмарк	13.50%	26.93%	15.19%
DFNEW	10.39%	10.77%	-3.81%

Стандартното отклонение е измерено на седмична база за последните 52 седмици. Промяната на индексите е в местна валута. До голяма степен именно поради значителния спад на някои валути към еврото се дължи и голямото разминаване между представянето на фонда и индексите, измерени в местна валута. На долната графика това изменение на валутите е изчистено, като служебния бенчмарк е представен в лева.

Движение на цената на фонда спрямо служебния бенчмарк в лева


Служебният бенчмарк представлява промяната във възвращаемостта на индексите ISE 100, SOFIX, BET-XT и CROBEX взети с равно тегло.

Позитивизмът от последните месеци продължи и през февруари. Изглежда пазарите вярват, че е възможно икономиките да се движат в траектория едновременно с ниски лихви, задоволителен ръст и умерена инфлация. Икономическите данни от за последните три месеца поддържат този оптимистичен възглед, но все пак нивото на лихвите зависи до голяма степен от действията на централните банки. Федералния Резерв в САЩ изглежда, че е доста вероятно отново да повиши лихвите през март и ако се запази настоящия позитивен контекст в икономиката да продължи с повишаването. Към момента пазара отразява с най-висока вероятност повишаване на лихвите през 2017 г. до 1.25-1.75% от настоящите 0.5-0.75%. Разбира се това са най-краткосрочните лихви, а на пазара на акции в много по-висока степен въздействат дългосрочните лихви, върху които ФЕД няма особено въздействие и които все още са много ниски спрямо историческите им стойности.

Все пак докато продължава да е в сила това изключително стечение на ниски лихви, приличен растеж и благоприятна инфлация, може да се очаква, че и пазарите на акции ще се движат по-скоро позитивно.

Представяне на фонда за последната година - по месеци

Доходност по месеци	Средно аритметично за индексите	DFNEW
Февруари 2016	0.50%	0.95%
Март 2016	4.19%	5.20%
Април 2016	-0.04%	-0.22%
Май 2016	-2.10%	-4.10%
Юни 2016	0.28%	0.51%
Юли 2016	2.67%	1.46%
Август 2016	1.55%	3.22%
Септември 2016	3.28%	0.43%
Октомври 2016	2.74%	-1.70%
Ноември 2016	1.01%	-3.77%
Декември 2016	3.35%	3.07%
Януари 2017	4.59%	4.02%
Февруари 2017	3.07%	2.64%

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

Активи	30.11.2016	31.12.2016	31.1.2017	28.2.2017	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права и КИС	6 897 194	7 134 032	7 462 304	7 692 777	93.46%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	583 147	576 400	554 935	535 240	6.50%
Депозити до 3 мес.	0	0	0	0	0.00%
Вземания	0	1 326	0	1 115	0.01%
Разходи за бъдещи периоди	174	0	1 876	1 719	0.02%
Общо:	7 480 515	7 711 758	8 019 114	8 230 851	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “СКАЙ Нови Акции” акции

Дружество	31.1.2017			28.2.2017			
	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							
Софарма АД - София	85035	3.379	287333	85035	3.48	295922	3.60%
М и С ХИДРАВЛИК АД	11490	6.574	75535	11490	6.94	79787	0.97%
Албена АД	1213	61.206	74243	1213	60.38	73245	0.89%
ЗЪРНЕНИ ХРАНИ БЪЛГАРИЯ АД	9766	0.377	3682	9766	0.37	3643	0.04%
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	130000	0.293	38090	130000	0.28	36400	0.44%
Монбат АД	20000	9.867	197340	20000	10.18	203600	2.47%
София Комерс - заложни къщи 2	4812	3.850	18526	4812	3.76	18093	0.22%
Химимпорт АД	62578	1.630	102002	62578	1.61	100751	1.22%
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.001	149	149450	0.00	149	0.00%

¹ Цени в съответната валута

ЧЕЗ РАЗПРЕДЕЛЕНИЕ БЪЛГАРИЯ АД	600	226.112	135667	600	239.00	143400	1.74%
Индустриален Холдинг България АД	48333	1.002	48430	48333	1.02	49300	0.60%
ИД Елана високодоходен фонд	3316	105.606	350188	3316	104.69	347148	4.22%
Общо:			1331186			1351437	16.42%
АКЦИИ ХЪРВАТСКА							
KONCHAR ELECTROINDUSTRIJA D.D.	844	815.00	179882	844	849.92	188661	2.29%
KONCHAR TRANSFORMATORI	412	1611.00	173573	412	1799.99	195043	2.37%
Duro Dakovic holding	1000	44.42	11616	1000	46.37	12196	0.15%
Atlanska Plovitba D.D. DUBROVNIK	730	327.00	62425	730	307.80	59095	0.72%
Adris P-A	560	481.00	70440	560	504.00	74230	0.90%
Общо:			497936			529225	6.43%
АКЦИИ РУМЪНИЯ							
CNTEE TRANSELECTRICA SA	29275	32.40	411975	29275	33.50	424342	5.16%
TRANSGAZ SA MEDIAS	900	323.00	126262	900	362.00	140969	1.71%
Petrom Bucuresti	3000000	0.28	368754	3000000	0.30	388120	4.72%
S.N.G.N. ROMGAZ S.A.	5000	27.45	59613	5000	28.30	61225	0.74%
SIF OLTENIA CRAIOVA	335000	1.62	236298	335000	1.66	241197	2.93%
SIF Transilvania /SIF 3/	400000	0.25	44042	400000	0.25	43269	0.53%
SIF MOLDOVA BACAU	468000	0.82	166682	468000	0.83	167668	2.04%
SIF Banat Crisana /SIF 1/	250000	1.89	205008	250000	1.92	208122	2.53%
SNO - Santierul Naval Orsova	17700	2.81	21603	17700	2.90	22210	0.27%
Farmaceutica Remedia SA	104000	0.19	8583	104000	0.20	9000	0.11%
SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/	1466649	0.89	565039	1466649	0.91	577486	7.02%

BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	24420	11.48	121763	24420	11.98	126583	1.54%
ОБЩО			2335622			2410191	29.28%
АКЦИИ СЪРБИЯ							
Veterinarski zavod AD	3017	238.00	11329	3017	231.00	11000	0.13%
Novosadski sajam a.d. Novi Sad	1745	1520.06	41851	1745	550.00	15149	0.18%
NIS AD NOVI SAD	3881	744.00	45558	3881	760.00	46556	0.57%
RTC LUKA LEGET A.D.	223	3170.75	11156	223	3170.75	11160	0.14%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	210	1720.00	5699	210	1749.00	5797	0.07%
ALFA PLAM a.d. Vranje	266	33096.00	138902	266	35254.00	148015	1.80%
Agrobanka a.d. Beograd	132	0.01	0	132	0.01	0	0.00%
Общо			254496			237678	2.89%
АКЦИИ ТУРЦИЯ							
TURK TRAKTOR	6500	78.60	245923	6500	77.55	256801	3.12%
TAV HAVALIMANLARI	33000	15.53	246688	33000	15.17	255036	3.10%
MIGROS	6000	18.45	53286	6000	19.70	60217	0.73%
Enka Insaat Ve Sanayi AS	26130	5.74	72196	26130	5.64	75079	0.91%
YAPI VE KREDI BANKASI	63000	3.83	116145	63000	3.85	123567	1.50%
Turkcell	15000	11.34	81878	15000	11.88	90784	1.10%
Haci Omer Sabanci Holding	16888	9.98	81128	16888	10.07	86638	1.05%
KOC HOLDING	34755	15.19	254119	34755	14.83	262579	3.19%
iŞ BANKASI (C)	33800	5.96	96967	33800	6.33	108999	1.32%
T. GARANTI BANKASI	42500	8.32	170206	42500	8.62	186637	2.27%
EREĞLİ DEMİR ÇELİK /EREGL	62000	5.81	173393	62000	5.94	187620	2.28%
Arcelik /ARCLK.E	21000	22.86	231078	21000	20.88	223384	2.71%

ADANA CIMENTO C	219360	0.90	95030	219360	0.83	92755	1.13%
ADANA CIMENTO A	21000	7.01	70860	21000	6.78	72535	0.88%
Общо			1988898			2082632	25.30%
АКЦИИ СЛОВЕНИЯ							
KRKA DD	5475	52.00	556825	5475	52.00	556825	6.77%
ZAVAROVALNICA TRIGLAV	4483	24.75	217008	4483	26.80	234982	2.85%
Общо			773832			791807	9.62%
ISHARES JPM EMERG BOND	1400	102.38	280333	1400	105.84	289807	3.52%
Общо:			7462304			7692777	93.46%

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:

10.3.2017 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 организирания 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.