

ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ НОВИ АКЦИИ”

01.5.2018 г. - 31.5.2018 г.

Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на месец май нетните активи на фонда са 8 143 767.55 лв., което представлява намаление от -359 917.84 лв. спрямо края на месец април. Броят на емитираните дялове се увеличава с 1 004.3690 до 11 196 449.7796.

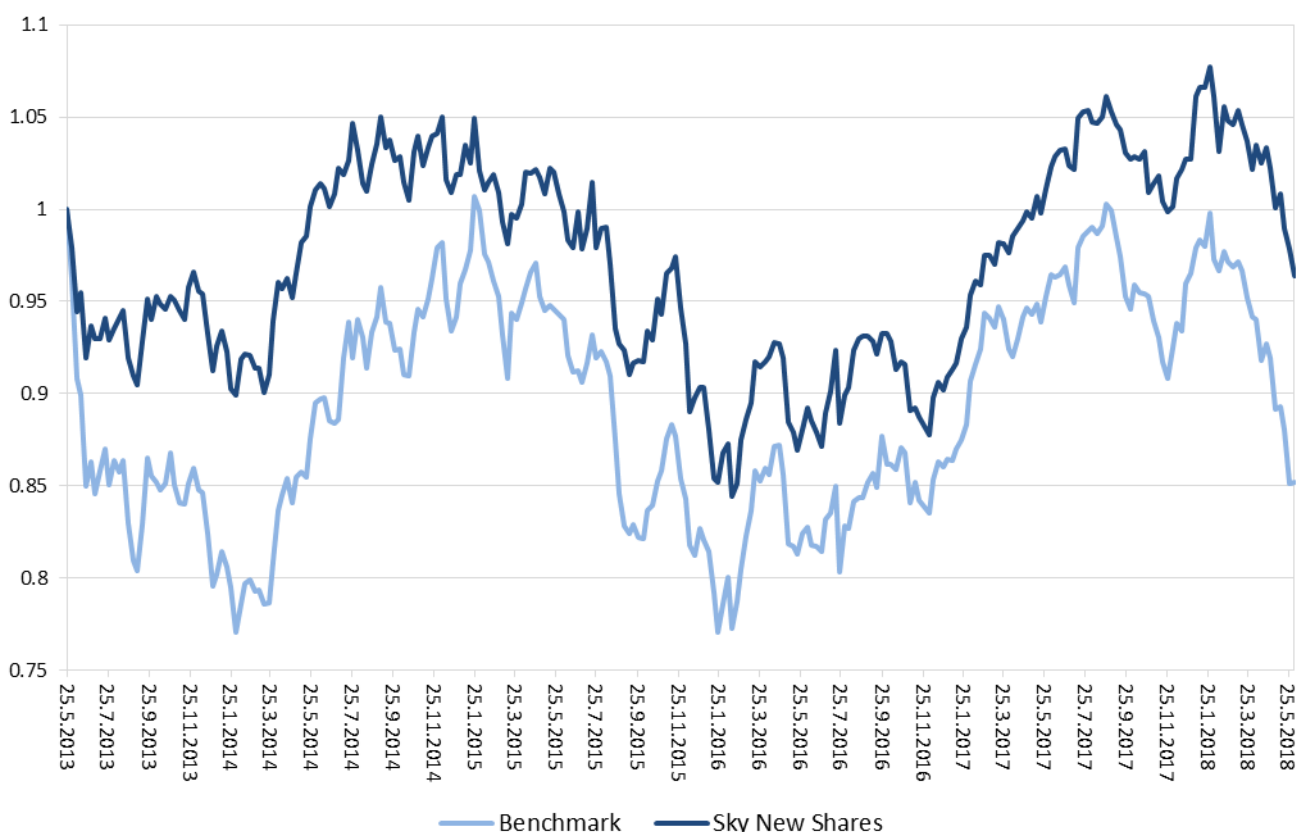
Изменение на индексите в местна валута и разпределение на портфейла по държави

Изменение	Q1 2017	Q2 2017	Q3 2017	Q4 2017	Q1 2018	Май 2018
SOFIX	8.1%	11.0%	-2.2%	-1.5%	-4.2%	-3.28%
CROBEX	-0.3%	-6.2%	-2.9%	1.8%	-2.1%	2.45%
BELEX 15	2.1%	-2.9%	1.3%	5.4%	-1.5%	0.29%
BET-XT	13.0%	-1.6%	2.9%	0.0%	10.3%	-8.09%
ISE 100	13.8%	12.9%	2.5%	12.5%	-0.7%	-3.48%
ДФ Скай Нови Акции	7.41%	4.82%	0.365%	0.0%	0.17%	-4.24%
Средно аритметично за индексите	7.35%	2.63%	0.32%	3.64%	0.38%	-2.42%
ДФ Скай Нови Акции стандартно отклонение						8.48%
Дял на съответната държава от активите на фонда	31.3.2017	30.6.2017	30.9.2017	31.12.2017	31.03.2018	31.05.2018
България	16.92%	16.58%	16.46%	16.20%	15.81%	16.75%
Хърватска	6.06%	5.72%	5.50%	6.04%	5.90%	6.28%
Сърбия	2.84%	3.36%	4.52%	3.85%	3.76%	4.10%
Румъния	29.07%	26.73%	28.54%	28.53%	30.34%	29.40%
Турция	25.43%	28.47%	23.38%	23.10%	22.10%	19.22%
Словения	9.50%	9.33%	9.56%	9.96%	11.36%	12.44%
Други	3.47%	3.13%	5.37%	5.34%	5.24%	5.53%

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

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 разминаването 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 за последните 5 години



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

През май пазарите, бяха до голяма степен движени от политически причини. Американския пазар бе доминиран от темата - Ще има или не търговска война. Непредсказуемостта на Тръмп едновременно създава нестабилност, но същевременно създава нагласа в пазарите да очакват неочакваното, които очаквания всъщност снижават колебанията. От другата страна на Атлантика на дневен ред отново се оказва популизма в Италия. Две евро-скептични партии, Северна Лига и Файв Стар, въпреки значителните различия по между си успяха да сформират правителство, което за два дена създаде мини паника на пазарите заради първоначално предложението финансов министър – силен привърженик на излизането на Италия от Еврозоната. След вето от италианския президент, двете партии предложиха нов кандидат и пазарите се успокоиха, макар че италианските облигации все още се търгуват на исторически висок спред спрямо германските. На Балканите борсите отново бяха засегнати от политически грип. В Румъния се въртят слухове за приватизация на пенсионните им фондове, което силно натисна пазара на акции. В Турция интервю на Ердоган по Блумбърг, че смята да оказва влияние върху Турската Централна Банка, може би дадено с цел успокоение на инвеститорите,

всъщност постигна обратното, като свали значително курса на турската лира, а от тук и на фондовата им борсата. Нещо може би приемано добре сред избирателите му в Турция, но внасящо значим смут сред чуждите инвеститори.

Представяне на фонда за последната година - по месеци

Доходност по месеци	Средно аритметично за индексите	DFNEW
Май 2017	1.82%	1.92%
Юни 2017	-0.34%	0.52%
Юли 2017	3.30%	2.83%
Август 2017	0.10%	0.00%
Септември 2017	-2.95%	-2.39%
Октомври 2017	1.76%	-1.21%
Ноември 2017	-0.80%	-1.35%
Декември 2017	2.73%	2.61%
Януари 2018	4.11%	4.27%
Февруари 2018	-1.86%	-1.24%
Март 2018	-1.82%	-2.72%
Април 2018	-1.92%	-1.57%
Май 2018	-2.42%	-4.24%

Обем и структура на инвестициите в портфейла

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

Активи	28.2.2018	31.3.2018	30.4.2018	31.5.2018	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права и КИС	8 339 530	8 201 464	8 062 674	7 654 595	93.73%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	561 907	475 039	462 640	465 700	5.70%
Депозити до 3 мес.	0	0	0		
Вземания	691	0	0	45 134	0.55%
Разходи за бъдещи периоди	1 845	1 658	1 478	1 395	0.02%
Общо:	8 903 972	8 678 161	8 526 791	8 166 824	100.00%

Информация за паричните средства

Към 31.5.2018 г. Фонда няма депозити. Паричните средства са по сметки на Фонда в банката-депозитар Юробанк България АД.

Стойност на притежаваните от ДФ “СКАЙ Нови Акции” финансови инструменти

Дружество	30.4.2018			31.5.2018			
	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							
ИД ЕЛАНА ВИСОКОДОХОДЕН ФОНД	3316	107.54	356594	3316	106.68	353766	4.33%
СОФАРМА АД - СОФИЯ	85035	4.21	358167	85035	4.11	349783	4.28%
АЛБЕНА АД	1213	57.75	70051	1213	57.09	69249	0.85%
ЗЪРНЕНИ ХРАНИ БЪЛГАРИЯ АД	9766	0.35	3379	9766	0.34	3340	0.04%
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	110275	0.61	67268	110275	0.62	68371	0.84%
МОНБАТ АД	20000	8.85	177000	20000	8.60	172000	2.11%
СОФИЯ КОМЕРС - ЗАЛОЖНИ КЪЩИ 2	4812	3.54	17050	4812	3.60	17323	0.21%
ХИМИМПОРТ АД	62578	2.33	145744	62578	2.25	140725	1.72%
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.00	149	149450	0.00	149	0.00%
ЧЕЗ РАЗПРЕДЕЛЕНИЕ БЪЛГАРИЯ АД	572	254.67	145670	572	256.00	146432	1.79%
ИНДУСТРИАЛЕН ХОЛДИНГ БЪЛГАРИЯ АД	48333	0.98	47366	48333	0.98	47125	0.58%
ОБЩО:			1388438			1368263	16.75%
АКЦИИ ХЪРВАТСКА							
KONCHAR ELECTROINDUSTRIJA D.D.	844	665.00	148142	844	675.00	150837	1.85%
KONCHAR TRANSFORMATORI	412	1860.00	202266	412	1910.00	208350	2.55%
ATLANSKA PLOVITVA D.D. DUBROVNIK	730	550.00	105974	730	461.00	89102	1.09%
ADRIS P-A	560	422.00	62375	560	434.00	64349	0.79%
ОБЩО:			518758			512637	6.28%
АКЦИИ РУМЪНИЯ							
CNTEE TRANSELECTRICA SA	29275	22.25	273301	29275	19.70	242530	2.97%

¹ Цени в съответната валута

TRANSGAZ SA MEDIAS	900	398.00	150294	900	370.00	140038	1.71%
PETROM BUCURESTI	3000000	0.34	431118	3000000	0.31	386052	4.73%
S.N.G.N. ROMGAZ S.A.	5000	37.20	78042	5000	35.05	73699	0.90%
SIF OLTENIA CRAIOVA	335000	2.13	299391	335000	1.97	277533	3.40%
SIF TRANSILVANIA /SIF 3/	400000	0.23	37762	400000	0.21	35325	0.43%
SIF MOLDOVA BACAU	468000	1.38	271767	468000	1.20	236173	2.89%
SIF BANAT CRISANA /SIF 1/	250000	2.60	272727	250000	2.36	248116	3.04%
SNO - SANTIERUL NAVAL ORSOVA	17700	3.00	22280	17700	2.84	21140	0.26%
FARMACEUTICA REMEDIA SA	104000	0.42	18327	104000	0.42	18282	0.22%
SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/	1466649	0.95	585839	1466649	0.97	595191	7.29%
BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE BUCURESTI	24420	15.00	153692	24420	12.40	127342	1.56%
ОБЩО			2594540			2401421	29.40%
АКЦИИ СЪРБИЯ							
VETERINARSKI ZAVOD AD	3017	88.00	4394	3017	81.00	4045	0.05%
NOVOSADSKI SAJAM A.D. NOVI SAD	1745	623.00	17992	1745	623.00	17995	0.22%
NIS AD NOVI SAD	3881	723.00	46440	3881	725.00	46573	0.57%
RTC LUKA LEGET A.D.	223	3120.74	11518	223	3120.74	11519	0.14%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	3210	1811.00	96212	3210	1900.00	100952	1.24%
ALFA PLAM A.D. VRANJE	266	35000.00	154083	266	35000.00	154101	1.89%
AGROBANKA A.D. BEOGRAD	132	0.01	0	132	0.01	0	0.00%
ОБЩО			330639			335186	4.10%
АКЦИИ ТУРЦИЯ							
TURK TRAKTOR	6500	60.50	157299	6500	58.60	141555	1.73%
TAV HAVALIMANLARI	33000	21.78	287495	33000	21.94	269070	3.29%
MIGROS	6000	22.80	54720	6000	19.87	44306	0.54%

ENKA INSAAT VE SANAYI AS	28619	4.89	55978	28619	4.46	47435	0.58%
YAPI VE KREDI BANKASI	63000	3.98	100296	63000	4.02	94120	1.15%
TRAKYA CAM SANAYI A.S	66828	4.69	125369	66828	4.00	99342	1.22%
TURKCELL	15000	13.96	83760	15000	12.00	66894	0.82%
TURKIYE SISE VE CAM FABRIKALARI A.S.	47195	4.51	85140	47195	3.98	69806	0.85%
İŞ BANKASI (C)	33800	6.16	83283	33800	5.96	74865	0.92%
T. GARANTI BANKASI	42500	9.21	156569	42500	8.91	140728	1.72%
EREĞLİ DEMİR ÇELİK /EREGL	62000	10.16	251967	62000	11.23	258753	3.17%
ARCELİK /ARCLK.E	21000	18.08	151871	21000	16.62	129707	1.59%
ADANA CIMENTO C	219360	1.12	98273	219360	1.03	83967	1.03%
ADANA CIMENTO A	21000	6.79	57036	21000	6.29	49089	0.60%
ОБЩО			1749053			1569637	19.22%
АКЦИИ СЛОВЕНИЯ							
TELEKOM SLOVENIJE	610	84.20	100455	610	88.00	104989	1.29%
KRKA DD	5475	57.80	618932	5475	57.20	612507	7.50%
ZAVAROVALNICA TRIGLAV	4483	34.00	298112	4483	34.00	298112	3.65%
ОБЩО			1017499			1015608	12.44%
ДРУГИ							
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	1200	92.47	217027	1200	85.38	200387	2.45%
ISHARES JPM EMERG BOND	1400	90.10	246719	1400	91.83	251456	3.08%
Общо:			463746			451843	5.53%
Общо:			8062674			7654595	93.73%

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:

07.06.2018 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.