

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

01.7.2020 г. - 31.7.2020 г.

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

Към края на месец юли нетните активи на фонда са 7 112 327.20 лв., което представлява увеличение от 5 732.87 лв. спрямо края на месец юни. Броят на емитираните дялове се увеличава с 290.1915 до 10 376 264.6917.

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

| Изменение  | Q3<br>2019       | Q4<br>2019        | Q1<br>2020        | Q2<br>2020        | Юни<br>2020       | Юли<br>2020       |
|--|------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| SOFIX  | -2.93%           | -0.43%            | -26.19%           | 8.09%             | 0.12%             | -3.71%            |
| CROBEX   | 4.27%            | 2.74%             | -28.04%           | 11.70%            | -0.85%            | -2.71%            |
| BELEX 15   | 2.66%            | 6.74%             | -20.60%           | 4.61%             | -1.09%            | 0.30%             |
| BET-XT   | 8.62%            | 5.67%             | -23.24%           | 12.38%            | -1.29%            | -3.03%            |
| ISE 100  | 9.55%            | 8.25%             | -21.66%           | 29.99%            | 10.43%            | -3.29%            |
| ДФ Скай Нови Акции                                     | 4.62%            | 5.37%             | -21.54%           | 12.26%            | 3.01%             | 0.07%             |
| Средно аритметично за индексите                        | 4.43%            | 4.60%             | -23.95%           | 13.35%            | 1.47%             | <b>-2.49%</b>     |
| ДФ Скай Нови Акции стандартно отклонение               |                  |                   |                   |                   |                   | <b>18.81%</b>     |
| <b>Дял на съответната държава от активите на фонда</b> | <b>30.9.2019</b> | <b>31.12.2019</b> | <b>31.03.2020</b> | <b>31.05.2020</b> | <b>30.06.2020</b> | <b>31.07.2020</b> |
| България   | 14.59%           | 15.00%            | 14.43%            | 12.88%            | 12.67%            | 12.40%            |
| Хърватска  | 7.99%            | 7.41%             | 6.11%             | 6.74%             | 6.81%             | 6.86%             |
| Сърбия   | 4.82%            | 4.35%             | 4.80%             | 4.02%             | 3.73%             | 3.84%             |
| Румъния  | 28.40%           | 28.66%            | 28.04%            | 28.74%            | 27.45%            | 27.20%            |
| Турция   | 17.71%           | 19.53%            | 14.79%            | 15.07%            | 16.79%            | 16.87%            |
| Словения   | 13.09%           | 14.05%            | 13.36%            | 14.45%            | 14.34%            | 14.36%            |
| Други  | 5.62%            | 5.56%             | 5.53%             | 5.51%             | 5.57%             | 5.43%             |

**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.

От началото на годината пазарите претърпяха доста сериозни флукутации. Голяма част от тях дължащи се на изключително високата несигурност за икономическото развитие и за резултатите на компаниите поради COVID-19 и мерките на правителствата за справяне с епидемията. През юли обаче ситуацията до известна степен се стабилизира. Икономическите данни излизащи по света са очаквано зле, резултатите на компаниите също отразяват потиснатото второ тримесечие.

Точно излизащите резултати на компании предизвикаха въздишка на облекчение. В общи линии те се движиха според очакванията. Нямаше големи изненади, и отново приличен процент от компаниите бият очакванията. Голямата неизвестна, до колко сериозната икономическа криза ще се отрази на финансовия сектор и дали няма да предизвика и финансова криза, се реши положително. Резултатите към края на юни не изглеждат да показват, че има сериозни сътресения в банките. За това несъмнено допринесоха и навременните и доста мащабни стимули от централните банки.

В крайна сметка повечето развити пазари завършиха месеца леко на отрицателна територия, а развиващите се – особено на тези от Азия и Латинска Америка на положителна.

Към момента голямата неизвестна, която остава на хоризонта е потенциална втора вълна на епидемията през есента. Особено ако мащаба и е такъв, че да изисква отново прилагане на силно ограничителни мерки. Това би могло значително да отложи във времето икономическото възстановяване, като същевременно настоящите държавни стимули да се окажат недостатъчни. Все пак изглежда, че държавите са решени да си защитят икономиките, така че подобни резки спадове като през март са относително по-слабо вероятни на есен.

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

| Доходност по месеци | Средно аритметично за индексите | DFNEW   |
|---------------------|---------------------------------|---------|
| Юли 2019            | 2.51%                           | 3.04%   |
| Август 2019         | -1.90%                          | -2.43%  |
| Септември 2019      | 3.85%                           | 4.25%   |
| Октомври 2019       | -1.67%                          | -0.47%  |
| Ноември 2019        | 2.96%                           | 4.32%   |
| Декември 2019       | 3.40%                           | 1.49%   |
| Януари 2020         | 1.72%                           | 2.04%   |
| Февруари 2020       | -7.02%                          | -9.28%  |
| Март 2020           | -19.51%                         | -15.25% |
| Април 2020          | 6.68%                           | 4.98%   |
| Май 2020            | 4.61%                           | 3.81%   |
| Юни 2020            | 1.47%                           | 3.01%   |
| Юли 2020            | -2.49%                          | 0.07%   |

### Обем и структура на инвестициите в портфейла

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

| Активи                    | 30.4.2020 | 31.5.2020 | 30.6.2020 | 31.7.2020 | Структура на активите спрямо общата им стойност /%/ |
|---------------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|---|
| Акции и права и КИС       | 5 875 067 | 6 055 322 | 6 226 186 | 6 203 454 | 86.96%  |
| Облигации                 | -         | -         | -         | -         |   |
| Парични средства          | 795 417   | 782 935   | 848 078   | 928 093   | 13.01%  |
| Депозити до 3 мес.        |           |           |           |           | 0.00%   |
| Вземания                  | 0         | 87 357    | 51 753    | 1 402     | 0.02%   |
| Разходи за бъдещи периоди | 1 540     | 1 345     | 1 157     | 962       | 0.01%   |
| Общо:                     | 6 672 024 | 6 926 960 | 7 127 174 | 7 133 911 | 100.00%   |

**Информация за паричните средства**

Към 31.7.2020 г. Фондът 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                        | 30.6.2020        |                           |                         | 31.7.2020        |                           |                         |                     |
|----------------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------|---------------------|
|                                  | 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               | 85035            | 3.16                      | 268626                  | 85035            | 2.95                      | 250853                  | 3.52%               |
| АЛБЕНА АД                        | 1213             | 29.48                     | 35762                   | 1213             | 26.40                     | 32023                   | 0.45%               |
| ЗЪРНЕНИ ХРАНИ БЪЛГАРИЯ АД        | 9766             | 0.14                      | 1406                    | 9766             | 0.14                      | 1320                    | 0.02%               |
| СОФИЯ КОМЕРС - ЗАЛОЖНИ КЪЩИ 2    | 4812             | 5.90                      | 28391                   | 4812             | 6.10                      | 29353                   | 0.41%               |
| ХИМИМПОРТ АД                     | 62578            | 1.04                      | 65081                   | 62578            | 1.00                      | 62453                   | 0.88%               |
| ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ        | 129450           | 0.00                      | 129                     | 129450           | 0.00                      | 129                     | 0.00%               |
| ЧЕЗ РАЗПРЕДЕЛЕНИЕ БЪЛГАРИЯ АД    | 260              | 190.00                    | 49400                   | 260              | 216.00                    | 56160                   | 0.79%               |
| ИНДУСТРИАЛЕН ХОЛДИНГ БЪЛГАРИЯ АД | 48333            | 0.76                      | 36733                   | 48333            | 0.76                      | 36733                   | 0.51%               |
| ЦКБ АД                           | 104527           | 1.04                      | 108708                  | 104527           | 0.99                      | 103273                  | 1.45%               |
| ИД ЕЛАНА ВИСОКОДОХОДЕН ФОНД      | 3316             | 93.11                     | 308762                  | 3316             | 94.11                     | 312060                  | 4.37%               |
| ОБЩО:                            |                  |                           | 902998                  |                  |                           | 884358                  | 12.40%              |
| АКЦИИ ХЪРВАТСКА                  |                  |                           |                         |                  |                           |                         |                     |
| KONCHAR ELECTROINDUSTRIJA D.D.   | 844              | 466.00                    | 101606                  | 844              | 525.00                    | 115836                  | 1.62%               |
| KONCHAR TRANSFORMATORI           | 824              | 1350.00                   | 287376                  | 824              | 1300.00                   | 280035                  | 3.93%               |
| ATLANSKA PLOVITVA D.D. DUBROVNIK | 730              | 218.00                    | 41112                   | 730              | 206.00                    | 39313                   | 0.55%               |
| ADRIS P-A                        | 560              | 380.00                    | 54975                   | 560              | 369.00                    | 54020                   | 0.76%               |

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

|  |         |          |         |         |          |         |        |
|--|---------|----------|---------|---------|----------|---------|--------|
| ОБЩО:                                      |         |          | 485069  |         |          | 489204  | 6.86%  |
| АКЦИИ РУМЪНИЯ                              |         |          |         |         |          |         |        |
| CNTEE TRANSELECTRICA SA                    | 29275   | 20.30    | 240163  | 29275   | 21.70    | 257161  | 3.60%  |
| TRANSGAZ SA MEDIAS                         | 900     | 292.00   | 106203  | 900     | 277.00   | 100919  | 1.41%  |
| S.N.G.N. ROMGAZ S.A.                       | 5000    | 31.90    | 64457   | 5000    | 28.45    | 57584   | 0.81%  |
| SIF OLTENIA CRAIOVA                        | 335000  | 2.20     | 297838  | 335000  | 2.18     | 295631  | 4.14%  |
| SIF TRANSILVANIA /SIF 3/                   | 400000  | 0.36     | 58355   | 400000  | 0.35     | 56511   | 0.79%  |
| SIF MOLDOVA BACAU                          | 433307  | 1.31     | 229393  | 433307  | 1.29     | 226274  | 3.17%  |
| SIF BANAT CRISANA /SIF 1/                  | 250000  | 2.27     | 229339  | 250000  | 2.18     | 220620  | 3.09%  |
| SNO - SANTIERUL NAVAL ORSOVA               | 17700   | 3.46     | 24749   | 17700   | 3.50     | 25078   | 0.35%  |
| FARMACEUTICA REMEDIA SA                    | 104000  | 0.53     | 22065   | 104000  | 0.57     | 23787   | 0.33%  |
| SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/ | 1119562 | 1.26     | 570074  | 1119562 | 1.25     | 564244  | 7.91%  |
| BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE BUCURESTI      | 24420   | 11.56    | 114082  | 24420   | 11.40    | 112694  | 1.58%  |
| ОБЩО                                       |         |          | 1956718 |         |          | 1940502 | 27.20% |
| АКЦИИ СЪРБИЯ                               |         |          |         |         |          |         |        |
| NOVOSADSKI SAJAM A.D. NOVI SAD             | 1740    | 233.81   | 6767    | 1740    | 233.81   | 6767    | 0.09%  |
| NIS AD NOVI SAD                            | 3881    | 570.00   | 36799   | 3881    | 548.00   | 35374   | 0.50%  |
| KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD              | 3210    | 2175.00  | 116139  | 3210    | 2400.00  | 128139  | 1.80%  |
| ALFA PLAM A.D. VRANJE                      | 266     | 24008.00 | 106231  | 266     | 23500.00 | 103972  | 1.46%  |
| AGROBANKA A.D. BEOGRAD                     | 132     | 0.01     | 0       | 132     | 0.01     | 0       | 0.00%  |
| ОБЩО                                       |         |          | 265935  |         |          | 274252  | 3.84%  |
| АКЦИИ ТУРЦИЯ                               |         |          |         |         |          |         |        |
| TURK TRAKTOR                               | 6500    | 78.75    | 130423  | 6500    | 108.00   | 166232  | 2.33%  |
| MIGROS                                     | 6000    | 38.50    | 58858   | 6000    | 44.76    | 63594   | 0.89%  |
| ENKA INSAAT VE SANAYI AS                   | 34840   | 6.16     | 54683   | 34840   | 6.49     | 53543   | 0.75%  |

|                                      |        |       |         |        |       |         |        |
|--------------------------------------|--------|-------|---------|--------|-------|---------|--------|
| YAPI VE KREDI BANKASI                | 122419 | 2.44  | 76108   | 122419 | 2.14  | 62036   | 0.87%  |
| TRAKYA CAM SANAYI A.S                | 73925  | 3.59  | 67620   | 73925  | 3.78  | 66170   | 0.93%  |
| TURKCELL                             | 15000  | 16.44 | 62832   | 15000  | 14.86 | 52782   | 0.74%  |
| TURKIYE SISE VE CAM FABRIKALARI A.S. | 47195  | 5.55  | 66739   | 47195  | 5.77  | 64484   | 0.90%  |
| OYAK CIMENTOFABRIKALARI ANONIM SIR   | 191543 | 7.08  | 345533  | 191543 | 8.31  | 376916  | 5.28%  |
| T. GARANTI BANKASI                   | 42500  | 8.46  | 91612   | 42500  | 7.02  | 70649   | 0.99%  |
| EREĞLİ DEMİR ÇELİK /EREGL            | 62000  | 8.58  | 135541  | 62000  | 7.64  | 112166  | 1.57%  |
| ARCELİK /ARCLK.E                     | 21000  | 19.90 | 106479  | 21000  | 23.08 | 114771  | 1.61%  |
| ОБЩО                                 |        |       | 1196427 |        |       | 1203344 | 16.87% |
| АКЦИИ СЛОВЕНИЯ                       |        |       |         |        |       |         |        |
| TELEKOM SLOVENIJE                    | 610    | 47.00 | 56074   | 610    | 49.60 | 59176   | 0.83%  |
| KRKA DD                              | 4475   | 82.80 | 724694  | 4475   | 83.00 | 726444  | 10.18% |
| ZAVAROVALNICA TRIGLAV                | 4483   | 27.50 | 241120  | 4483   | 27.20 | 238489  | 3.34%  |
| ОБЩО                                 |        |       | 1021887 |        |       | 1024109 | 14.36% |
| ДРУГИ                                |        |       |         |        |       |         |        |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG          | 1200   | 56.82 | 133356  | 1200   | 54.70 | 128381  | 1.80%  |
| ISHARES JPM EMERG BOND               | 1400   | 96.34 | 263795  | 1400   | 94.70 | 259304  | 3.63%  |
| Общо:                                |        |       | 397151  |        |       | 387685  | 5.43%  |
| Общо:                                |        |       | 6226186 |        |       | 6203454 | 86.96% |

### 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:**

07.8.2020 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.