

ИНФОРМАЦИЯ

СЪГЛАСНО ИЗИСКВАНИЯТА НА ЧЛ. 72, АЛ. 2 ОТ НАРЕДБА № 44,

ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ НОВИ АКЦИИ”
(ПРЕДИШНО НАИМЕНОВАНИЕ СТАТУС НОВИ АКЦИИ)

ИЗГОТВЕНА ОТ УД „СКАЙ УПРАВЛЕНИЕ НА АКТИВИ” АД

ЗА ПЕРИОДА ОТ 01.9.2013 Г. ДО 30.09.2013 Г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

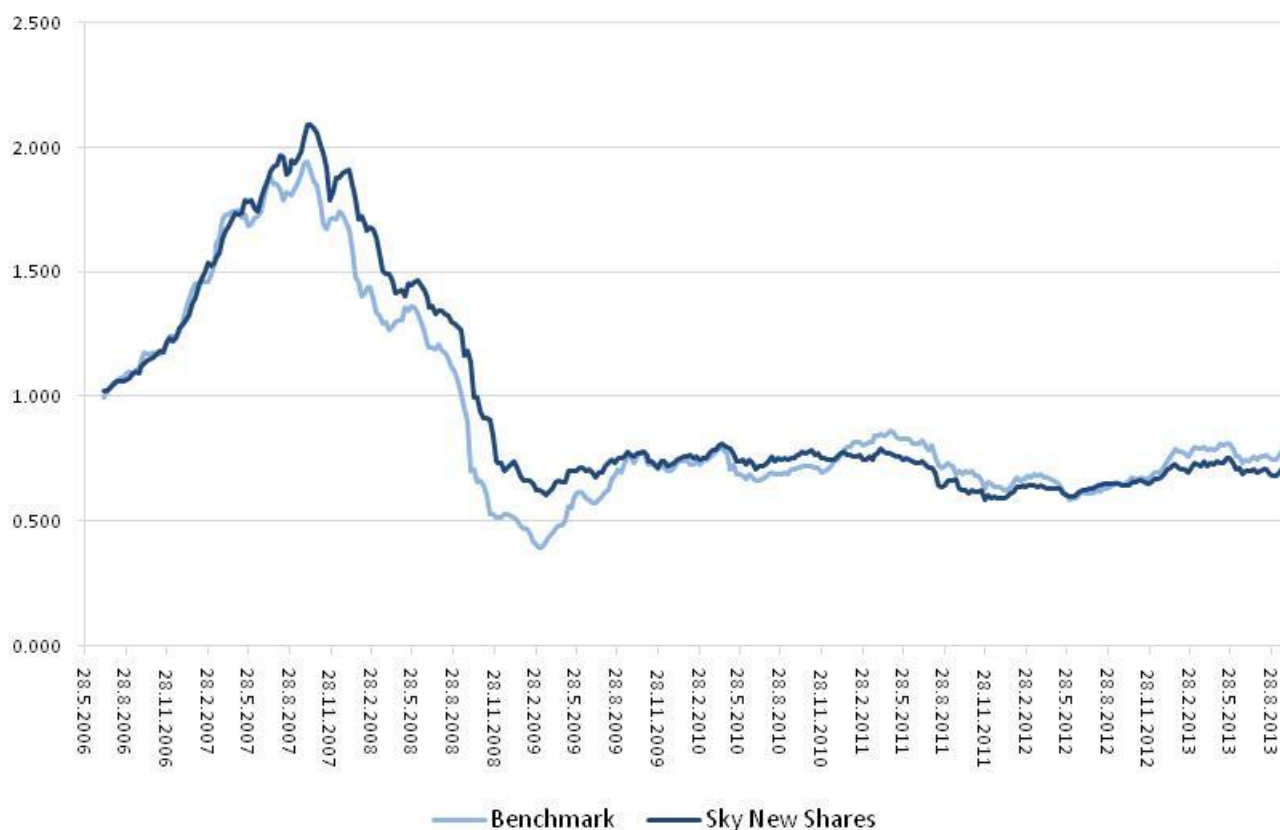
Към края на месец септември нетните активи на фонда са б 746 716.3200 лв., което представлява увеличение от 47 176.8421 лв. спрямо края на месец август. Броят на емитираните дялове намалява с -246 792.2785 и достигат 9 573 012.0977.

Изменение	Q3 2012	Q4 2012	Q1 2013	Q2 2013	Q3 2013	Септември 2013
SOFIX	10.57%	6.63%	11.24%	15.5%	2.8%	2.71%
CROBEX	1.26%	1.47%	15.37%	-10.1%	0.3%	-1.68%
BELEX 15	-1.14%	21.56%	10.31%	-16.9%	9.3%	0.75%
BET-C	2.69%	6.50%	9.03%	-7.1%	12.6%	0.00%
ISE 100	6.16%	17.79%	9.83%	-11.2%	-2.4%	12.19%
DFNEW	2.74%	7.40%	7.00%	-4.6%	0.27%	3.31%
Средно аритметично за индексите	3.91%	10.79%	11.16%	-5.97%	4.55%	2.79%
Дял на съответната държава от активите на фонда	30.09.2012	31.12.2012	31.03.2013	30.06.2013	30.09.2013	
България	14.58%	20.76%	21.47%	19.06%	21.84%	
Хърватска	6.29%	5.62%	6.40%	5.41%	5.12%	
Сърбия и Македония	2.79%	2.71%	3.68%	3.01%	3.33%	
Румъния	23.68%	23.87%	24.23%	20.46%	22.89%	
Турция	26.99%	31.24%	32.95%	26.97%	26.17%	
Други	0.60%	0.44%	-	-	-	

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

Индекс	Стандартно отклонение	Изменение 12 месеца	Изменение 24 месеца
SOFIX	13.64%	40.82%	17.46%
CROBEX	9.91%	5.56%	-2.37%
BELEX 15	13.35%	21.78%	-5.04%
BET-C	12.28%	18.11%	20.05%
ISE 100	27.02%	12.18%	24.78%
Служебен бенчмарк	12.67%	19.69%	10.98%
DFNEW	11.61%	9.97%	11.73%

Стандартното отклонение е измерено на седмична база за последните 52 седмици.

Движение на цената на фонда спрямо служебния бенчмарк в лева


Въпреки очакванията, че септември ще бъде един волатилен месец за пазарите, те всъщност се успокоиха. Преекспонирането през август на въздействието на промяната на американската парична политика върху развиващите се пазари създаде впечатление за възможна силна промяна в отношението към развиващите се пазари. В последствие след решението на ФЕД за отлагане на намаляването на паричните стимули на пазарите настана известно успокоение. Валутите на развиващите се пазари реализираха известно поскъпване, а тъй като именно валутните пазари служеха за индикатор за бягство или прилив на капитали, то и капиталовите им пазари се успокоиха.

Политическите проблеми в САЩ постепенно излизат на дневен ред. Желанието на републиканците в конгреса да премахнат Обамакеър/реформи в здравеопазването предприети от Обама с цел по-достъпно здравеопазване в САЩ/ доведе до доста радикални действие от тяхна

страна – включително негласуване на нов бюджет и съответно спиране на всички дейности на американското правителство от несъществено значение. Макар че това реално не се отразява пряко на пазарите, е възможно да се отрази в някаква степен на възстановяването на американската икономика и от тук косвено на фондовите пазари. Доста по-сериозна заплаха от страна на републиканците е да не гласуват увеличение на така нар. „таван на дълга”. Въпреки наименованието си, това всъщност представлява упълномощаване от страна на Конгреса за заплащане на вече направени и реално гласувани от Конгреса разходи, а не карт бланш за увеличение на дълга в бъдеще. По този начин негласуването на този „таван на дълга” заплашва САЩ да навлезе в технически фалит, поради нежелание за плащане на дълговете си. Това би имало изключително сериозни последици както за американската, така и за световната икономика. Точно поради изключителната сериозност на последициите от подобна заплаха, пазарите реално не вярват, че републиканците ще я осъществят.

Доходност по месеци	Средно аритметично за индексите	DFNEW
Септември.12	-0.72%	-1.43%
Октомври.12	3.93%	3.21%
Ноември.12	0.72%	-0.79%
Декември.12	5.73%	4.88%
Януари 2013	7.93%	2.56%
Февруари 2013	0.82%	0.45%
Март 2013	2.34%	3.86%
Април 2013	-1.07%	-0.22%
Май 2013	-0.75%	-0.04%
Юни 2013	-4.58%	-4.32%
Юли 2013	1.88%	-0.54%
Август 2013	-0.86%	-2.42%
Септември 2013	2.79%	3.31%

Обща промяна на петте индекса при база 28/05/2006



Обем и структура на инвестициите в портфейла



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

Активи	30.6.2013	31.7.2013	31.8.2013	30.9.2013	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	4 915 170	4 856 179	4 744 852	5 369 404	79.36%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	1 025 550	1 436 502	1 395 565	846 734	12.51%
Депозити до 3 мес.	497 515	499 069	500 000	500 000	7.39%
Вземания	120 975	97 067	77 772	49 085	0.73%
Разходи за бъдещи периоди	1 094	910	725	547	0.01%
Общо:	6 560 304	6 889 728	6 718 914	6 765 769	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “СКАЙ Нови Акции” акции

Дружество	31.8.2013			30.9.2013			
	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							
ЧЕЗ РАЗПРЕДЕЛЕНИЕ БЪЛГАРИЯ АД	109	1568.98	171019	109	1530.63	166838	2.47%
АЛБЕНА ИНВЕСТ ХОЛДИНГ	5317	5.54	29435	5317	6.20	32971	0.49%
СОФИЯ КОМЕРС - ЗАЛОЖНИ КЪЩИ АД	8237	5.25	43244	5812	5.50	31937	0.47%
СОФАРМА АД - СОФИЯ	81992	3.29	269754	81992	3.28	269098	3.98%
ИНДУСТРИАЛЕН ХОЛДИНГ БЪЛГАРИЯ АД	23333	0.93	21653	23333	0.87	20300	0.30%
М И С ХИДРАВЛИК АД	3830	9.26	35454	3830	9.30	35604	0.53%
ТРЕЙС ГРУП ХОЛД АД	6272	3.47	21758	6272	3.72	23300	0.34%
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	282929	0.64	181075	282929	0.64	181075	2.68%

¹ Цени в съответната валута

АКТИВ ПРОПЪРТИС АДСИЦ	133940	0.18	24645	133940	0.19	25181	0.37%
ФОНД ЗА НЕДВИЖИМИ ИМОТИ БЪЛГАРИЯ АДСИЦ	140100	0.54	75934	140100	0.54	75234	1.11%
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.30	45179	149450	0.30	45179	0.67%
ДФ ДСК РАСТЕЖ	365468	0.74	270545	365468	0.75	275062	4.07%
ИД ЕЛАНА ВИСОКОДОХОДЕН ФОНД				1475	83.52	123192	1.82%
ДФ ЕЛАНА ГЛОБАЛЕН ФОНД В АКЦИИ				598	204.21	122100	1.80%
ОББ ПЛАТИНУМ ЕВРО ОБЛИГАЦИИ	251	103.22	50720	251	103.35	50786	0.75%
Общо:			1240415			1477856	21.84%
АКЦИИ ХЪРВАТСКА							
ADRIС P-A	560	276.00	39942	560	267.00	38401	0.57%
ATLANSKA PLOVITVA D.D. DUBROVNIK	230	307.61	18284	230	362.63	21421	0.32%
DURO DAKOVIC HOLDING	1000	65.20	16849	1000	64.29	16512	0.24%
KONCHAR TRANSFORMATORI	412	1155.00	122974	412	1100.00	116395	1.72%
KONCHAR ELECTROINDUSTRIJA D.D.	844	699.02	152463	844	710.00	153902	2.27%
Общо:			350512			346631	5.12%
АКЦИИ РУМЪНИЯ							
BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE BUCURESTI	24420	8.50	91600	24420	9.00	96336	1.42%
CNTEE TRANSELECTRICA SA	29275	13.30	171822	29275	13.72	176057	2.60%
PETROM BUCURESTI	1100000	0.44	211161	1100000	0.45	216009	3.19%
SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/	1680000	0.68	504879	1680000	0.76	559660	8.27%
SIF BANAT CRISANA /SIF 1/	125000	1.05	57920	125000	1.09	59449	0.88%
SIF MOLDOVA BACAU	234000	1.23	127117	234000	1.25	128519	1.90%
SIF OLTENIA CRAIOVA	335000	1.53	226187	335000	1.61	236413	3.49%

SIF TRANSILVANIA	200000	0.58	51102	200000	0.60	52731	0.78%
FARMACEUTICA REMEDIA SA	104000	0.29	13310	104000	0.28	12924	0.19%
SNO - SANTIERUL NAVAL ORSOVA	17700	1.49	11638	17700	1.40	10870	0.16%
ОБЩО			1466736			1548967	22.89%
АКЦИИ СЪРБИЯ							
AGROBANKA A.D. BEOGRAD	132	0	0	132	0.00	0	0.00%
AIK BANKA A.D. NIŠ	2774	1474	69890	2774	1430.00	67697	1.00%
ALFA PLAM A.D. VRANJE	266	12000	54560	266	12050.00	54701	0.81%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	210	1325	4756	210	1290.00	4623	0.07%
RTC LUKA LEGET A.D.	223	3067	11692	223	3067.36	11673	0.17%
NIS AD NOVI SAD	3881	863	57248	3881	837.00	55437	0.82%
NOVOSADSKI SAJAM A.D. NOVI SAD	1745	176	5258	1745	176.27	5249	0.08%
VETERINARSKI ZAVOD AD	3017	504	25990	3017	505.00	26001	0.38%
Общо			229393			225383	3.33%
АКЦИИ ТУРЦИЯ							
AKBANK	20666	6.78	101996	20666	7.44	109312	1.62%
AK ENERJI SHS	26457	1.15	22148	26457	1.31	24641	0.36%
ENKA INSAAT VE SANAYI AS	19908	4.89	70865	19908	6.00	84922	1.26%
T. GARANTI BANKASI	59500	7.04	304920	59500	7.96	336721	4.98%
İŞ BANKASI (C)	33800	4.78	117609	33800	5.34	128321	1.90%
KOC HOLDING	34755	8.24	208468	34755	9.32	230289	3.40%
MIGROS	6000	16.45	71848	6000	16.95	72304	1.07%
HACI OMER SABANCI HOLDING	16888	8.70	106953	16888	9.76	117184	1.73%
TAV HAVALIMANLARI	18000	11.05	144787	33000	14.25	334325	4.94%

TURK TRAKTOR	2500	54.00	98272	2500	59.00	104865	1.55%
TURKCELL	15000	10.70	116834	15000	11.90	126905	1.88%
YAPI VE KREDI BANKASI	31500	4.06	93096	31500	4.50	100777	1.49%
Общо			1457796			1770567	26.17%
Общо:			4744852			5369404	79.36%

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:

10.10.2013 г.

Съставил:

Иван Иванов: