

ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ НОВИ АКЦИИ”

01.12.2019 г. - 31.12.2019 г.

Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на месец декември нетните активи на фонда са 8 096 676.46 лв., което представлява увеличение от 109 615.56 лв. спрямо края на месец ноември. Броят на емитираните дялове се увеличава с 390.3735 до 10 424 046.6980.

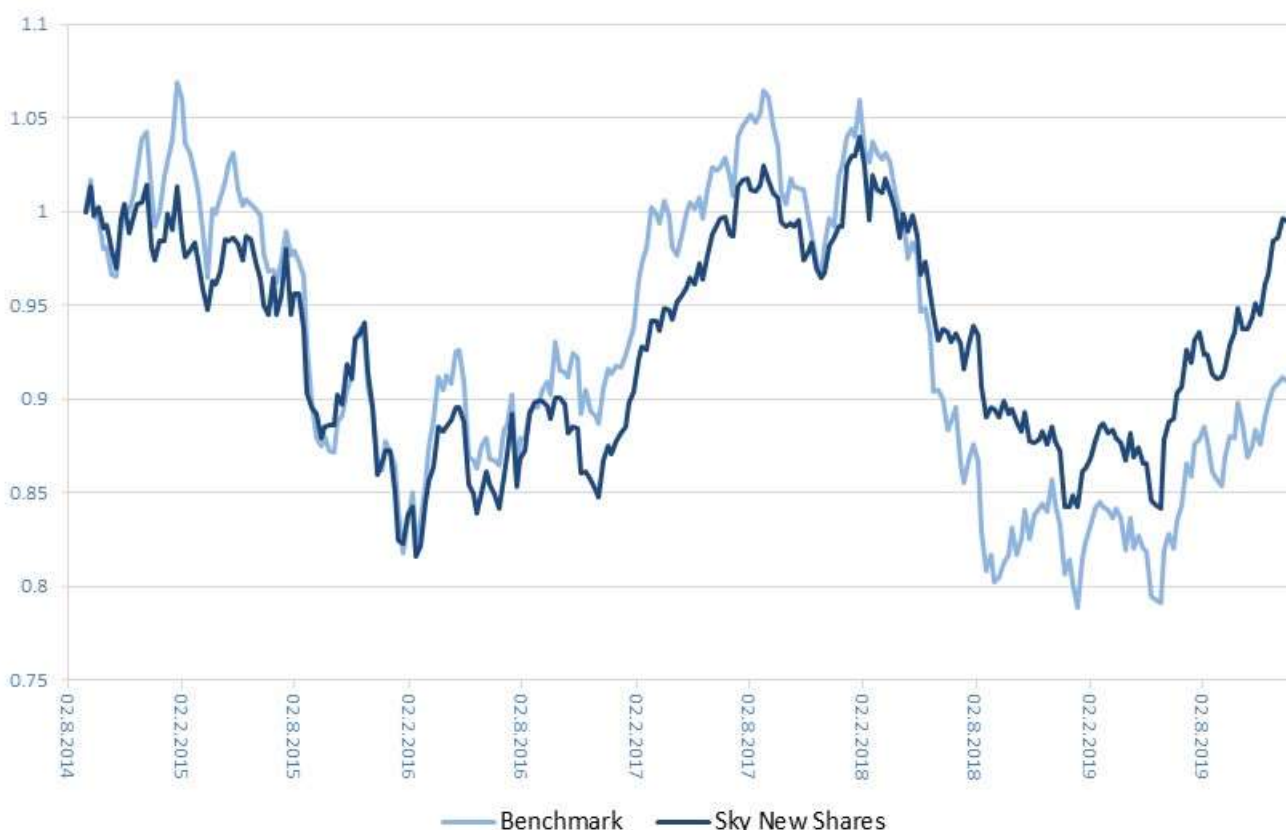
Изменение на индексите в местна валута и разпределение на портфейла по държави

Изменение	Q4 2018	Q1 2019	Q2 2019	Q3 2019	Q4 2019	Декември 2019
SOFIX	-4.79%	-1.8%	0.67%	-2.93%	-0.43%	3.95%
CROBEX	-1.87%	2.8%	4.74%	4.27%	2.74%	1.09%
BELEX 15	4.76%	-3.8%	-0.18%	2.66%	6.74%	3.99%
BET-XT	-11.47%	8.0%	8.45%	8.62%	5.67%	0.92%
ISE 100	-8.69%	2.8%	2.88%	9.55%	8.25%	7.04%
ДФ Скай Нови Акции	-4.40%	1.42%	4.53%	4.62%	5.37%	1.49%
Средно аритметично за индексите	-4.41%	1.60%	3.31%	4.43%	4.60%	3.40%
ДФ Скай Нови Акции стандартно отклонение						8.12%
Дял на съответната държава от активите на фонда	31.12.2018	31.3.2019	30.6.2019	30.9.2019	31.12.2019	
България	16.83%	16.29%	15.60%	14.59%	15.00%	
Хърватска	6.58%	6.73%	7.27%	7.99%	7.41%	
Сърбия	4.73%	4.97%	4.82%	4.82%	4.35%	
Румъния	27.42%	27.00%	28.22%	28.40%	28.66%	
Турция	17.65%	17.74%	17.17%	17.71%	19.53%	
Словения	13.65%	13.82%	13.84%	13.09%	14.05%	
Други	5.90%	5.97%	5.73%	5.62%	5.56%	

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.

Основното пазарно развитие през декември бе съгласието за подписване на първата фаза на търговската сделка между САЩ и Китай. Самата сделка все още да не е ясно какво включва и е далеч от решаване на основните конфликти между САЩ и Китай, като защита на правата на интелектуална собственост. Съгласието по този ограничен кръг от проблеми, които се решават на този етап отлага налагането на допълнителни санкции от страна на САЩ върху вноса от Китай.

Реално пазарите бяха калкулирали подобно развитие, като и през декември продължиха положителния си тренд. Развиващите се пазари също участваха в движението, като едни от най-добре представилите се основни пазари бяха именно те. Извън търговските преговори икономическите показатели, които излязоха през месеца също подкрепиха ръста на пазарите. Дори в Европа, където промишления PMI от месеци показва рецесия в индустрията, изненада нагоре в стойността, макар и все още да се намира на територия показваща свиване на промишлената активност. Подобни бяха и

данните от Китай, където промишления PMI е за втори месец над 50, след няколко месеца показващи рецесия.

Представяне на фонда за последната година - по месеци

Доходност по месеци	Средно аритметично за индексите	DFNEW
Декември 2018	-2.95%	-4.83%
Януари 2019	0.44%	3.39%
Февруари 2019	1.62%	1.94%
Март 2019	-0.04%	-2.36%
Април 2019	1.60%	-0.06%
Май 2019	-0.74%	1.35%
Юни 2019	2.47%	3.21%
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%

Обем и структура на инвестициите в портфейла

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

Активи	30.9.2019	31.10.2019	30.11.2019	31.12.2019	Структура на активите спрямо общата им стойност [%]
Акции и права и КИС	7 139 125	7 065 314	7 394 402	7 677 750	94.56%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	596 396	612 225	613 608	436 428	5.38%
Депозити до 3 мес.					0.00%
Вземания	5 108	1 797	0	5 214	0.06%
Разходи за бъдещи периоди	557	370	189	0	0.00%
Общо:	7 741 187	7 679 706	8 008 199	8 119 392	100.00%

Информация за паричните средства

Към 31.12.2019 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	30.11.2019			31.12.2019			
	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	3.38	287070	85035	3.41	289587	3.57%
АЛБЕНА АД	1213	39.60	48035	1213	41.87	50791	0.63%
ЗЪРНЕНИ ХРАНИ БЪЛГАРИЯ АД	9766	0.22	2183	9766	0.22	2149	0.03%
МОНБАТ АД	20000	6.30	126000	20000	6.41	128132	1.58%
СОФИЯ КОМЕРС - ЗАЛОЖНИ КЪЩИ 2	4812	6.35	30556	4812	6.69	32206	0.40%
ХИМИМПОРТ АД	62578	1.64	102922	62578	1.59	99224	1.22%
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.00	149	149450	0.00	149	0.00%
ЧЕЗ РАЗПРЕДЕЛЕНИЕ БЪЛГАРИЯ АД	260	211.54	55000	260	220.00	57200	0.70%
ИНДУСТРИАЛЕН ХОЛДИНГ БЪЛГАРИЯ АД	48333	1.00	48333	48333	1.01	48807	0.60%
ЦКБ АД				104527	1.52	158641	1.95%
ИД ЕЛАНА ВИСОКОДОХОДЕН ФОНД	3316	103.63	343629	3316	105.86	351036	4.32%
ОБЩО:			1043877			1217921	15.00%
АКЦИИ ХЪРВАТСКА							
KONCHAR ELECTROINDUSTRIJA D.D.	844	640.00	142026	844	635.00	140898	1.74%
KONCHAR TRANSFORMATORI	824	1500.00	324985	824	1460.00	316277	3.90%
ATLANSKA PLOVITVA D.D. DUBROVNIK	730	408.00	78312	730	375.00	71968	0.89%
ADRIS P-A	560	499.00	73474	560	495.00	72875	0.90%
ОБЩО:			618797			602018	7.41%
АКЦИИ РУМЪНИЯ							
CNTEE TRANSELECTRICA SA	29275	20.00	239454	29275	19.75	236426	2.91%

¹ Цени в съответната валута

TRANSGAZ SA MEDIAS	900	369.50	136004	900	360.00	132488	1.63%
S.N.G.N. ROMGAZ S.A.	5000	37.90	77500	5000	37.10	75853	0.93%
SIF OLTENIA CRAIOVA	335000	2.52	345255	335000	2.56	350684	4.32%
SIF TRANSILVANIA /SIF 3/	400000	0.36	58892	400000	0.39	64118	0.79%
SIF MOLDOVA BACAU	433307	1.59	281765	433307	1.61	285268	3.51%
SIF BANAT CRISANA /SIF 1/	250000	2.78	284236	250000	2.73	279083	3.44%
SNO - SANTIERUL NAVAL ORSOVA	17700	3.50	25336	17700	3.70	26780	0.33%
FARMACEUTICA REMEDIA SA	104000	0.39	16673	104000	0.36	15480	0.19%
SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/	1419562	1.20	693772	1419562	1.21	702378	8.65%
BRD-GROUPE SOCIETE GENERALE BUCURESTI	24420	15.30	152803	24420	15.84	158173	1.95%
ОБЩО			2311691			2326729	28.66%
АКЦИИ СЪРБИЯ							
NOVOSADSKI SAJAM A.D. NOVI SAD	1740	269.14	7789	1740	269.14	7789	0.10%
NIS AD NOVI SAD	3881	728.00	46994	3881	749.00	48348	0.60%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	3210	3250.00	173523	3210	3370.00	179922	2.22%
ALFA PLAM A.D. VRANJE	266	29710.00	131448	266	26500.00	117241	1.44%
AGROBANKA A.D. BEOGRAD	132	0.01	0	132	0.01	0	0.00%
ОБЩО			359755			353300	4.35%
АКЦИИ ТУРЦИЯ							
TURK TRAKTOR	6500	47.36	95269	6500	55.40	105366	1.30%
TAV HAVALIMANLARI	33000	26.90	274723	33000	29.18	281757	3.47%
MIGROS	6000	22.12	41074	6000	24.22	42521	0.52%
ENKA INSAAT VE SANAYI AS	31107	5.76	55451	31107	6.42	58435	0.72%
YAPI VE KREDI BANKASI	122419	2.40	90926	122419	2.48	88833	1.09%
TRAKYA CAM SANAYI A.S	73925	3.30	75497	73925	3.50	75707	0.93%

TURKCELL	15000	13.56	62948	15000	13.80	60568	0.75%
TURKIYE SISE VE CAM FABRIKALARI A.S.	47195	4.99	72883	47195	5.27	72775	0.90%
T. GARANTI BANKASI	42500	10.10	132843	42500	11.14	138532	1.71%
EREĞLİ DEMİR ÇELİK /EREGL	62000	8.02	153884	62000	9.04	163997	2.02%
ARCELİK /ARCLK.E	21000	20.12	130760	21000	20.84	128054	1.58%
ADANA CIMENTO C	439360	1.87	254267	439360	2.23	286683	3.53%
ADANA CIMENTO A	29136	6.99	63028	29136	9.71	82780	1.02%
ОБЩО			1503554			1586007	19.53%
АКЦИИ СЛОВЕНИЯ							
TELEKOM SLOVENIJE	610	57.00	68004	610	54.40	64902	0.80%
KRKA DD	5475	70.00	749572	5475	73.20	783838	9.65%
ZAVAROVALNICA TRIGLAV	4483	33.10	290220	4483	33.30	291974	3.60%
ОБЩО			1107796			1140714	14.05%
ДРУГИ							
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	1200	73.30	172035	1200	73.14	171659	2.11%
ISHARES JPM EMERG BOND	1400	101.13	276897	1400	102.04	279402	3.44%
Общо:			448931			451061	5.56%
Общо:			7394402			7677750	94.56%

Репо сделки

През периода не са сключвани договори за репо сделки, както и няма прекратени такива договори; не са закупвани, 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:

09.1.2020 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 организираниите 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.