

ИНФОРМАЦИЯ ЗА ПОРТФЕЙЛА НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СКАЙ НОВИ АКЦИИ”

01.5.2017 г. - 31.5.2017 г.

Изменение в нетните активи на фонда и броя емитирани дялове

Към края на месец май нетните активи на фонда са 8 594 586.43 лв., което представлява увеличение от 147 357.90 лв. спрямо края на месец април. Броят на емитираните дялове намалява на 11 254 634.5117.

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

Изменение	Q2 2016	Q3 2016	Q4 2016	Q1 2017	Април 2017	Май 2017
SOFIX	2.06%	10.8%	16.22%	8.1%	3.68%	0.60%
CROBEX	0.38%	15.8%	2.76%	-0.3%	-4.39%	-1.98%
BELEX 15	-0.23%	5.2%	12.74%	2.1%	-1.62%	0.72%
BET-XT	-4.07%	7.1%	2.50%	13.0%	1.44%	6.73%
ISE 100	-7.75%	-0.4%	2.16%	13.8%	6.42%	3.05%
DFNEW	-3.82%	5.17%	-2.50%	7.41%	2.31%	1.92%
Средно аритметично за индексите	-1.92%	7.7%	7.27%	7.35%	1.10%	1.82%
Дял на съответната държава от активите на фонда	30.06.2016	30.09.2016	31.12.2016	31.3.2017	30.4.2017	31.5.2017
България	14.12%	16.44%	16.14%	16.92%	16.89%	16.80%
Хърватска	4.91%	5.15%	5.78%	6.06%	6.15%	5.79%
Сърбия	4.09%	2.92%	3.00%	2.84%	2.71%	2.82%
Румъния	26.19%	27.15%	28.08%	29.07%	28.52%	29.28%
Турция	28.97%	26.70%	25.85%	25.43%	26.04%	28.18%
Словения	10.73%	10.87%	9.98%	9.50%	9.38%	9.50%
Други	3.71%	3.57%	3.69%	3.47%	3.36%	3.22%

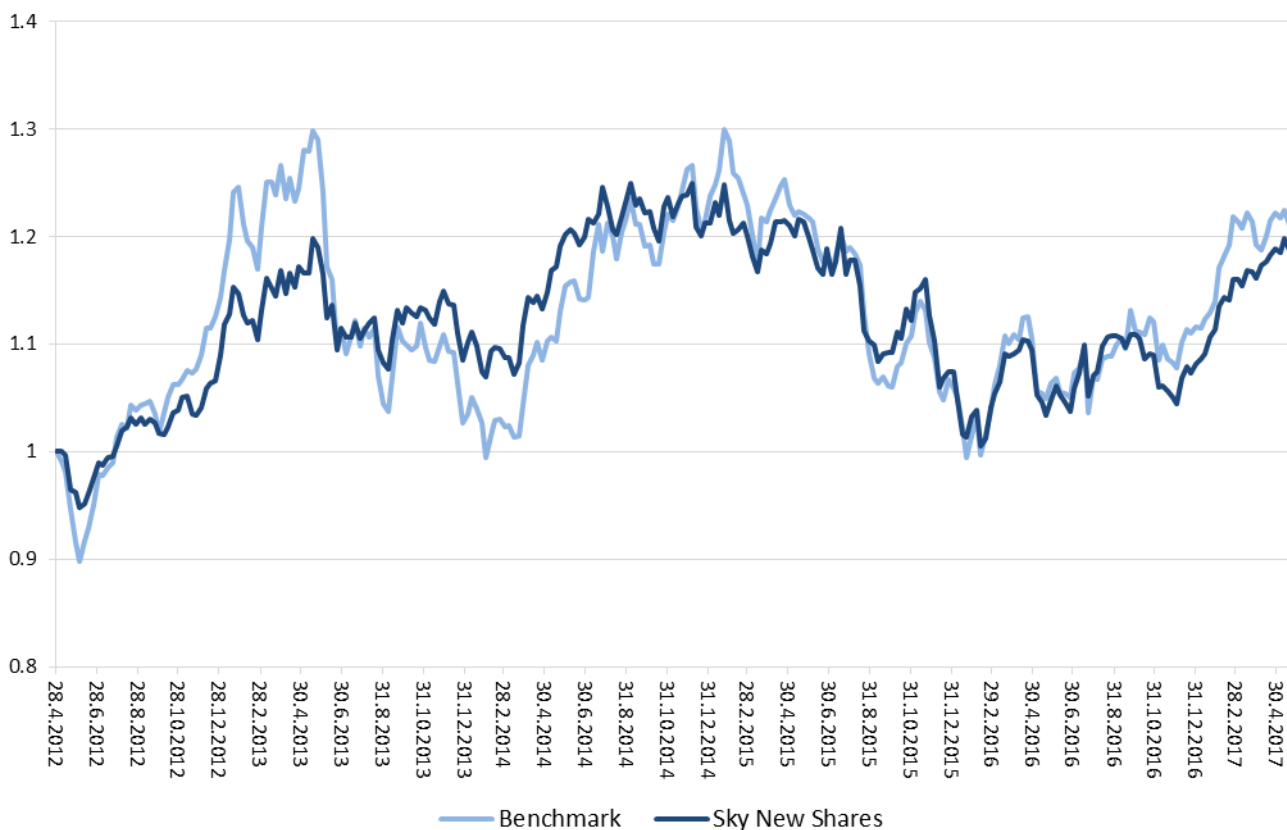
Информация за паричните средства

Към 31.5.2017 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	9.71%	49.82%	38.03%
CROBEX	11.87%	9.36%	7.79%
BELEX 15	11.02%	18.57%	2.44%
BET-XT	8.36%	37.37%	16.16%
ISE 100	21.90%	25.37%	17.55%
Служебен бенчмарк	12.06%	28.10%	16.39%
DFNEW	9.00%	15.43%	0.98%

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 за последните 5 години


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

Старата поговорка „Продавай през май и излизай от пазара“, не се оказва особено подходяща за настоящия май. С малки изключения, предимно в Латинска Америка, глобалните пазари продължиха малко по-малко да се изкачват нагоре. Вече, дори е трудно да се каже какво наблюдават пазарите. Нито добрите новини въздействат силно, нито лошите новини успяват да променят нещо. Изглежда, сякаш пазарът си е заложил някакъв план да се повишава малко и стабилно и гледа да го спазва, все едно какво се случва. Ако този тренд се задържи и през следващите месеци, със сигурност ще е едно от най-гладките възходящи движения през последните години.

Представяне на фонда за последната година - по месеци

Доходност по месеци	Средно аритметично за индексите	DFNEW
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%
Март 2017	-0.32%	0.60%
Април 2017	1.10%	2.31%
Май 2017	1.82%	1.92%

Обем и структура на инвестициите в портфейла

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

Активи	28.2.2017	31.3.2017	30.4.2017	31.5.2017	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права и КИС	7 692 777	7 722 546	7 881 698	8 235 752	95.58%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	535 240	552 780	578 276	352 002	4.09%
Депозити до 3 мес.	0	0	0	0	0.00%
Вземания	1 115	1 230	8 151	27 262	0.32%
Разходи за бъдещи периоди	1 719	1 545	1 377	1 203	0.01%
Общо:	8 230 851	8 278 101	8 469 502	8 616 219	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “СКАЙ Нови Акции” акции

	30.4.2017			31.5.2017			
Дружество	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	4.06	344902	85035	4.03	342606	3.98%
М и С ХИДРАВЛИК АД	11490	8.06	92609	11490	7.69	88404	1.03%
Албена АД	1213	62.20	75449	1213	61.46	74551	0.87%
ЗЪРНЕНИ ХРАНИ БЪЛГАРИЯ АД	9766	0.36	3496	9766	0.36	3526	0.04%
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	130000	0.28	36400	130000	0.28	36010	0.42%
Монбат АД	20000	10.99	219720	20000	10.97	219440	2.55%
София Комерс - заложни къщи 2	4812	3.93	18906	4812	3.89	18704	0.22%
Химимпорт АД	62578	1.55	96746	62578	1.72	107446	1.25%
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.00	149	149450	0.00	149	0.00%
ЧЕЗ РАЗПРЕДЕЛЕНИЕ БЪЛГАРИЯ АД	600	240.46	144275	572	268.17	153394	1.78%
Индустриален Холдинг България АД	48333	0.92	44466	48333	0.95	45820	0.53%
ИД Елана високодоходен фонд	3316	106.66	353689	3316	107.91	357816	4.15%
Общо:			1430808			1447867	16.80%
АКЦИИ ХЪРВАТСКА							
KONCHAR ELECTROINDUSTRIJA D.D.	844	800.00	176926	844	760.00	169225	1.96%
KONCHAR TRANSFORMATORI	412	1690.50	182504	412	1611.00	175106	2.03%
Duro Dakovic holding	1000	41.89	10977	1000	36.90	9735	0.11%
Atlanska Plovitba D.D. DUBROVNIK	730	433.66	82953	730	390.00	75110	0.87%
Adris P-A	560	458.40	67265	560	470.00	69437	0.81%

¹ Цени в съответната валута

Общо:			520625			498612	5.79%
АКЦИИ РУМЪНИЯ							
CNTEE TRANSELECTRICA SA	29275	32.00	404036	29275	33.20	416368	4.83%
TRANSGAZ SA MEDIAS	900	377.00	146338	900	449.00	173114	2.01%
Petrom Bucuresti	3000000	0.32	416630	3000000	0.33	423466	4.91%
S.N.G.N. ROMGAZ S.A.	5000	30.90	66635	5000	33.90	72613	0.84%
SIF OLTENIA CRAIOVA	335000	1.66	239843	335000	1.78	254877	2.96%
SIF Transilvania /SIF 3/	400000	0.25	43043	400000	0.25	42668	0.50%
SIF MOLDOVA BACAU	468000	0.84	169550	468000	0.94	188659	2.19%
SIF Banat Crisana /SIF 1/	250000	1.87	201630	250000	1.95	209270	2.43%
SNO - Santierul Naval Orsova	17700	3.00	22902	17700	2.98	22596	0.26%
Farmaceutica Remedia SA	104000	0.20	8814	104000	0.23	10292	0.12%
SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/	1466649	0.90	569301	1466649	0.91	573012	6.65%
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	24420	12.04	126808	24420	12.98	135788	1.58%
ОБЩО			2415530			2522722	29.28%
АКЦИИ СЪРБИЯ							
Veterinarski zavod AD	3017	171.00	8192	3017	175.00	8419	0.10%
Novosadski sajam a.d. Novi Sad	1745	550.00	15240	1745	750.00	20868	0.24%
NIS AD NOVI SAD	3881	745.00	45912	3881	737.00	45607	0.53%
RTC LUKA LEGET A.D.	223	3120.74	11051	223	3120.74	11096	0.13%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	210	1780.00	5936	210	1823.00	6104	0.07%
ALFA PLAM a.d. Vranje	266	34001.00	143614	266	35500.00	150568	1.75%
Agrobanka a.d. Beograd	132	0.01	0	132	0.01	0	0.00%
Общо			229943			242662	2.82%

АКЦИИ ТУРЦИЯ							
TURK TRAKTOR	6500	77.95	255695	6500	81.85	262209	3.04%
TAV HAVALIMANLARI	33000	14.80	246472	33000	17.29	281206	3.26%
MIGROS	6000	24.32	73639	6000	26.96	79724	0.93%
Enka Insaat Ve Sanayi AS	26130	5.46	71999	28619	5.36	75601	0.88%
YAPI VE KREDI BANKASI	63000	4.31	137028	63000	4.40	136618	1.59%
TRAKYA CAM SANAYI A.S				55000	3.95	107072	1.24%
Turkcell	15000	12.41	93941	15000	12.16	89896	1.04%
TURKIYE SISE VE CAM FABRIKALARI A.S.				43000	4.71	99817	1.16%
Haci Omer Sabanci Holding	16888	10.58	90169	16888	10.70	89059	1.03%
KOC HOLDING	34755	16.70	292904	34755	16.04	274750	3.19%
İŞ BANKASI (C)	33800	7.01	119571	33800	7.01	116775	1.36%
T. GARANTI BANKASI	42500	9.59	205684	42500	9.60	201083	2.33%
EREĞLİ DEMİR ÇELİK /EREGL	62000	6.51	203688	62000	6.39	195258	2.27%
Arcelik /ARCLK.E	21000	23.70	251165	21000	24.42	252744	2.93%
ADANA CIMENTO C	219360	0.81	89667	219360	0.86	92976	1.08%
ADANA CIMENTO A	21000	6.97	73866	21000	7.05	72967	0.85%
Общо			2205487			2427754	28.18%
АКЦИИ СЛОВЕНИЯ							
KRKA DD	5475	52.30	560037	5475	54.00	578241	6.71%
ZAVAROVNICA TRIGLAV	4483	26.72	234281	4483	27.45	240681	2.79%
Общо			794318			818922	9.50%
ISHARES JPM EMERG BOND	1400	104.08	284988	1400	101.24	277212	3.22%
Общо:			7881698			8235752	95.58%

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:

09.6.2017 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 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.