

ИНФОРМАЦИЯ

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

**ИЗГОТВЕНА ОТ УД „СТАТУС КАПИТАЛ” АД
ОТНОСНО ПОРТФЕЙЛА
НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СТАТУС НОВИ АКЦИИ”**

ЗА ПЕРИОДА от 01.1.2012 г. до 31.1.2012 г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на януари 2011 г. нетната стойност на активите на фонда е 3 757 472.34 лева, което представлява увеличение от 234 637.10 лева спрямо края на декември. За същия период дяловете в обращение се увеличават с 64 608.9300 и достигат до 6 028 286.7968 бр. Направените инвестиции са само в акции на публични дружества, за които се смята, че притежават потенциал да допринесат за покачване на нетната стойност на активите на договорния фонд, спазвайки ограниченията до 90% от общите активи да бъдат инвестирани в акции.

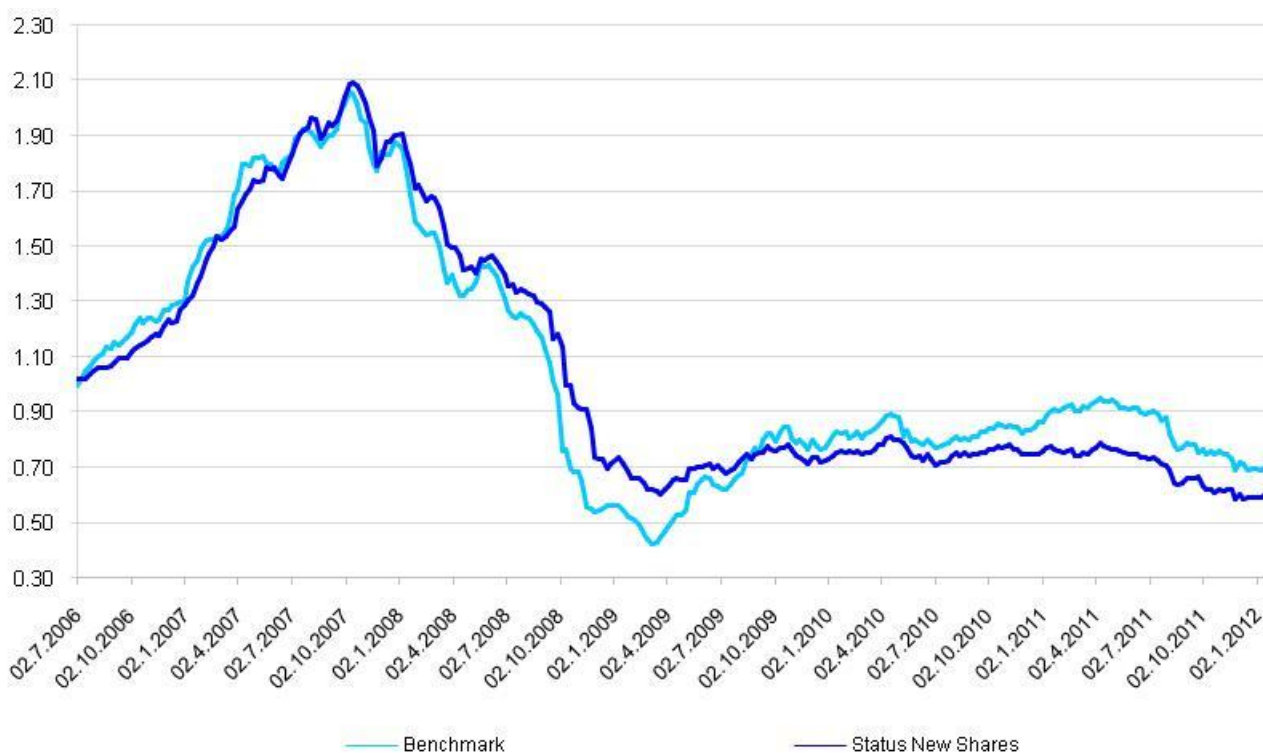
Изменение	Q3 2010	Q4 2010	Q 1 2011	Q2 2011	Q3 2011	Q4 2011	Януари 2012
SOFIX	3.8%	-8.41%	22.93%	-7.11%	-16.13%	-7.18%	0.24%
CROBEX	3.3%	-2.41%	8.50%	-2.60%	-16.87%	-6.16%	-0.74%
BELEX 15	-2.2%	2.38%	16.43%	-1.44%	-26.11%	-9.71%	0.19%
BET-C	10.6%	-0.14%	13.28%	-6.02%	-20.05%	-1.01%	10.67%
ISE 100	19.9%	4.54%	-2.38%	-1.81%	-5.65%	-14.12%	11.52%
DFNEW	6.71%	1.94%	2.02%	-5.3%	-13.90%	-6.36%	5.52%
Средно аритметично за индексите	7.1%	-0.81%	11.75%	-3.79%	-16.96%	-7.63%	4.38%
Дял на съответната държава от активите на фонда	30.09.2010	31.12.2010	31.03.2011	30.06.2011	30.09.2011	31.12.2011	31.01.2012
България	20.77%	19.96%	22.06%	22.76%	22.45%	16.05%	16.22%
Хърватска	8.25%	8.63%	10.25%	11.35%	10.92%	9.27%	8.39%
Сърбия и Македония	9.92%	9.09%	10.17%	8.65%	7.22%	5.61%	5.30%
Румъния	13.63%	11.17%	15.89%	13.32%	14.36%	17.78%	19.33%
Турция	30.26%	27.45%	21.36%	21.14%	23.20%	21.93%	24.33%

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

Индекс	Стандартно отклонение	Изменение 12 месеца	Изменение 24 месеца
SOFIX	16.47%	-18.90%	-25.86%
CROBEX	14.65%	-24.66%	-21.61%
BELEX 15	17.02%	-31.98%	-26.32%
BET-C	18.71%	-11.91%	-2.21%
ISE 100	25.93%	-9.65%	4.61%
Служебен бенчмарк	14.7%	-19.42%	-14.28%
DFNEW	14.0%	-16.95%	-17.60%

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

Движение на цената на фонда спрямо служебния бенчмарк



През януари се достигна до известно възвръщане на оптимизма на финансовите пазари. След значителното нарастване на възприетия риск през последните месеци, намесата на ЕЦБ за осигуряване на на практика неограничена ликвидност на банките от еврозоната донякъде успокои ситуацията. Очакванията са, че със значителна част от тези почти 490 милиарда евро банките ще закупват държавни ценни книжа на държавите от еврозоната. По този начин ЕЦБ избягва прякото си действие като кредитор от последна инстанция на правителства, решение което използваша САЩ и Великобритания, но е кредитор от последна инстанция на банките. В крайна сметка тези пари ще достигнат и до правителствата по един или друг начин. Въпреки тези очаквания, до момента, в който дълговите пазари на Италия и Испания не се върнат в нормалните си траектории, не би могло да се говори за решение на кризата в Европа. Действията на ЕЦБ, заедно със заявената решимост на европейските лидери да реформират механизмите за бюджетен контрол в Еврозоната, дават основателни причини да смятаме, че най-острата част от кризата в Еврозоната е преминала. Първи доказателства за това дават пазарите на държавни облигации, като италианските десет годишни облигации паднаха от над 7% до под 6% доходност.

За момента основните въпросителни са три - остава несигурна съдбата на Гърция, като яснота по въпроса ще се получи до края на март, когато Гърция трябва да плати част от облигациите си. Другите две са дали ЕС ще изпадне в рецесия и по какъв начин отделните банки ще решат проблема с отговора на новите изисквания за капиталова адекватност.

През януари започнахме постепенно увеличаване на дела на инвестираните в акции средства. Смятаме, че рисковите премии на пазарите достигнаха връх към края на миналата година и с постепенното намаляване на възприемания риск ще започне и възстановяване на пазарните индекси. Основната част от новите инвестиции бяха насочени към българския пазар, където от редица АДСИЦ може да се очакват привлекателни дивидентни доходности. Въпреки това подържаме най-висок дял в най-ликвидните пазари от региона Турция и Румъния тъй като очакваме, че постепенното възстановяване на пазарите ще се отрази в близък план най-силно на най-ликвидните пазари.

Смятаме при запазване на позитивните индикации от ЕС да увеличим дела на акциите в фонда до по-агресивните 80-85% през следващите месеци.

Доходност по месеци	Средно аритметично за индексите	DFNEW
Януари 2011	6.60%	-0.98%
Февруари 2011	3.02%	-0.35%
Март 2011	1.80%	3.38%
Април 2011	0.49%	-0.59%
Май 2011	-1.09%	-3.03%
Юни 2011	-2.87%	-1.70%
Юли 2011	-2.18%	-2.98%
Август.11	-9.94%	-7.65%
Септември.11	-5.66%	-3.90%
Октомври.11	-0.78%	-1.60%
Ноември.11	-7.09%	-4.53%
Декември .11	0.26%	-0.32%
Януари 2012	4.38%	5.52%

**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	31.10.2011	30.11.2011	31.12.2011	31.1.2012	Структура на активите спрямо общата им стойност !%/
Акции и права	2 471 312	2 573 802	2 496 058	2 772 115	73.56%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	1 042 108	548 550	167 984	122 879	3.26%
Депозити до 3 мес.	609 761	610 264	867 795	868 624	23.05%
Вземания	3 913	6 089	1 804	4 514	0.12%
Разходи за бъдещи периоди	366	186	0	297	0.01%
Общо:	4 127 460	3 738 891	3 533 642	3 768 429	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “Статус Нови Акции” акции

	31.12.2011			31.1.2012			
Дружество	Брой ценни книжа	Цена за брой	Балансова стойност	Брой ценни книжа	Цена за брой	Балансова стойност	Процент от активите
Акции България							
Албена инвест холдинг	5317	5.81	30908	5317	5.62	29871	0.79%
Софарма АД - София	3321	3.18	10544	3321	3.01	10003	0.27%
София Комерс - заложни къщи АД	9097	5.65	51398	9097	5.54	50352	1.34%
Индустриален Холдинг България АД	23333	0.61	14163	23333	0.65	15260	0.40%
М+С ХИДРАВЛИК АД	3830	6.984	26749	3830	7.214	27630	0.73%
ТРЕЙС ГРУП ХОЛД АД	4972	3.26	16209	4972	3.47	17263	0.46%
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	282929	0.59	166928	282929	0.55	155611	4.13%
ДФ ДСК РАСТЕЖ	255038	0.66	168366	255038	0.66	169151	4.49%
АДВАНС ТЕРАФОНД АДСИЦ - СОФИЯ	3300	1.430	4719	3300	1.45	4785	0.13%
ЕЛАРГ ФОНД ЗА ЗЕМЕДЕЛСКА ЗЕМЯ АДСИЦ				23168	1.21	27941	0.74%
ФЕЪРПЛЕЙ ПРОПЪРТИ АДСИЦ				93100	0.28	25975	0.69%
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.52	77254	149450	0.52	77254	2.05%
Общо:			567238			611095	16.22%
Акции Хърватска							
Adris P-A	560	56.83	31823	560	57.22	32043	0.85%
Atlanska Plovitba D.D. DUBROVNIK	230	85.89	19756	230	77.95	17928	0.48%
Duro Dakovic holding	1000	13.16	13156	1000	14.44	14440	0.38%
DALEKOVOD D.D.	550	33.48	18411	550	30.45	16750	0.44%
Institut IGH d.d	20	194.62	3892	20	217.31	4346	0.12%
Konchar Transformatori	412	268.58	110655	412	268.40	110582	2.93%

Konchar Electroindustrija D.D.	844	133.38	112574	844	124.43	105023	2.79%
ULJANIK PLOVIDBA D.D.	183	93.68	17143	183	82.90	15171	0.40%
Общо:			327411			316284	8.39%
Акции Румъния							
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	12400	4.85	60080	12400	4.96	61443	1.63%
CNTEE TRANSELECTRICA SA	8275	7.87	65138	8275	8.11	67097	1.78%
SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/	880000	0.19	169991	880000	0.22	195033	5.18%
SIF Banat Crisana /SIF 1/	65000	0.41	26553	125000	0.44	54619	1.45%
SIF MOLDOVA BACAU	234000	0.49	114329	234000	0.59	138613	3.68%
SIF OLTENIA CRAIOVA	335000	0.48	160190	335000	0.54	181841	4.83%
Farmaceutica Remedia SA	104000	0.09	9363	104000	0.09	9744	0.26%
SNO - Santierul Naval Orsova	17700	1.28	22581	17700	1.13	19933	0.53%
Общо			628224			728324	19.33%
Акции Сърбия							
Agrobanka a.d. Beograd	132	56.05	7399	132	27.99	3695	0.10%
AIK banka a.d. Niš	2673	30.80	82335	2673	32.99	88182	2.34%
ALFA PLAM a.d. Vranje	266	134.57	35797	266	141.99	37770	1.00%
Jedinstvo AD	42	90.74	3811	42	84.83	3563	0.09%
RTC LUKA LEGET A.D.	223	40.09	8940	223	53.56	11944	0.32%
Novosadski sajam a.d. Novi Sad	1951	21.49	41936	1951	18.81	36697	0.97%
Veterinarski zavod AD	3017	6.00	18101	3017	5.90	17803	0.47%
Общо			198320			199653	5.30%
Акции Турция							

Akbank	20666	4.82	99592	20666	5.87	121275	3.22%
AK ENERJI SHS	26457	1.47	38970	26457	1.74	45912	1.22%
Enka Insaat Ve Sanayi AS	15554	3.28	51050	15554	4.02	62589	1.66%
T. Garanti Bankasi	20000	4.72	94461	20000	5.55	110995	2.95%
IŞ BANKASI (C)	16800	2.65	44515	16800	3.19	53660	1.42%
Koc Holding	33100	4.55	150504	33100	5.75	190357	5.05%
Haci Omer Sabanci Holding	16888	4.32	73004	16888	5.62	94857	2.52%
TAV HAVALIMANLARI	18000	6.45	116139	18000	6.69	120418	3.20%
Turkcell	15000	7.11	106629	15000	7.78	116696	3.10%
Общо			774866			916760	24.33%
Общо:			2496058			2772115	73.56%

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:

10.2.2012 г.

Съставил:

Иван Иванов: