

ИНФОРМАЦИЯ

СЪГЛАСНО ИЗИСКВАНИЯТА НА ЧЛ. 48, АЛ. 3 ОТ НАРЕДБА № 25,

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

ЗА ПЕРИОДА ОТ 01.02.2010 Г. ДО 28.02.2010 Г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на февруари 2010 г. нетната стойност на активите е 3 534 439.16 лева, което представлява намаление от -53 376.08 лева спрямо края на януари. За същият период дяловете в обръщение намаляват с -6 600.4206 и достигат до 4 736 750.2676. 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.

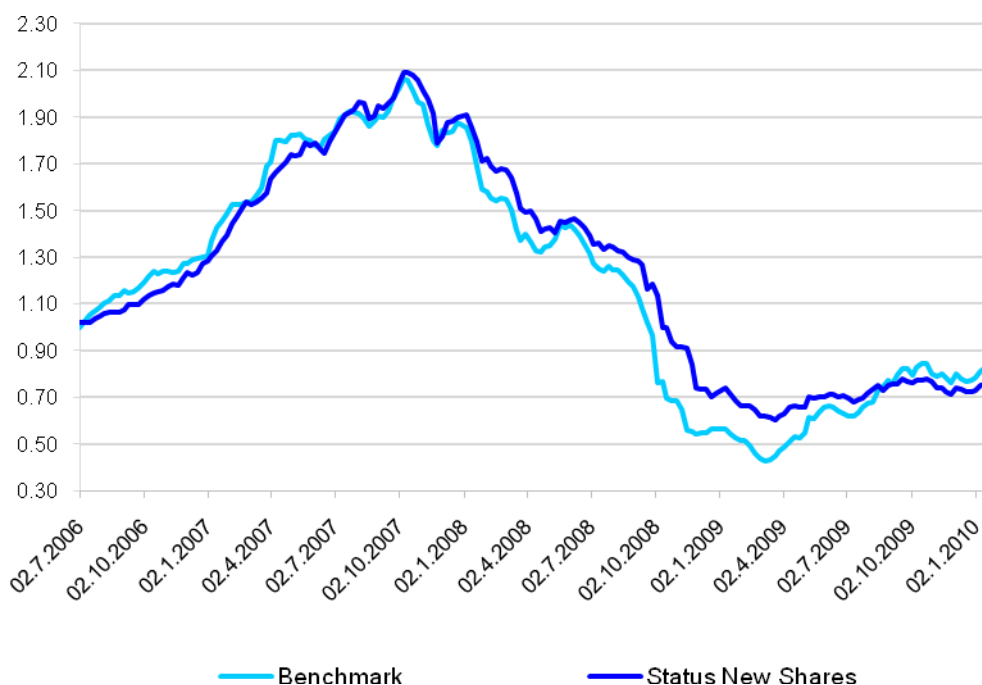
Изменение	Q4 2008	Q1 2009	Q2 2009	Q3 2009	Q4 2009	Февруари 2010
SOFIX	-54.7%	-22.4%	28.2%	34.6%	-11.01%	-2.69%
CROBEX	-42.6%	-15.4%	30.7%	15.9%	-8.80%	-3.0%
BELEX 15	-43.7%	-32.6%	49.5%	45.1%	-19.64%	4.06%
BET-C	-38.9%	-21.6%	35.7%	26.3%	2.14%	3.3%
ISE 100	-25.5%	-4.1%	43.0%	30.0%	10.26%	-9.05%
DFNEW	-37.10%	-19.2%	15.5%	8.3%	-4.89%	-1.35%
Средно аритметично за индексите	-41.1%	-17.65%	37.4%	30.4%	-5.41%	-1.47
Дял на съответната държава от активите на фонда	31.12.2008	31.03.2009	30.06.2009	30.09.2009	31.12.2009	28.02.2010
България	34.31%	40.19%	32.26%	27.33%	27.40%	26.60%
Хърватска	12.06%	12.22%	11.36%	10.92%	5.72%	7.93%
Сърбия и Македония	17.14%	12.55%	12.29%	12.49%	11.27%	12.01%
Румъния	8.60%	9.07%	9.42%	10.32%	14.36%	17.10%
Турция	8.70%	11.13%	15.05%	14.87%	16.92%	15.60%

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

Индекс	Стандартно отклонение	Изменение 12 месеца	Изменение 24 месеца
SOFIX	28.83%	60.09%	-70.36%
CROBEX	30.80%	54.52%	-49.48%
BELEX 15	42.82%	67.84%	-66.20%
BET-C	31.98%	146.14%	-41.11%
ISE 100	35.50%	106.88%	11.01%
Служебен бенчмарк	23.3%	87.09%	-43.23%
DFNEW	14.12%	20.1%	-55.5%

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

Движение на цената на фонда спрямо служебния бенчмарк



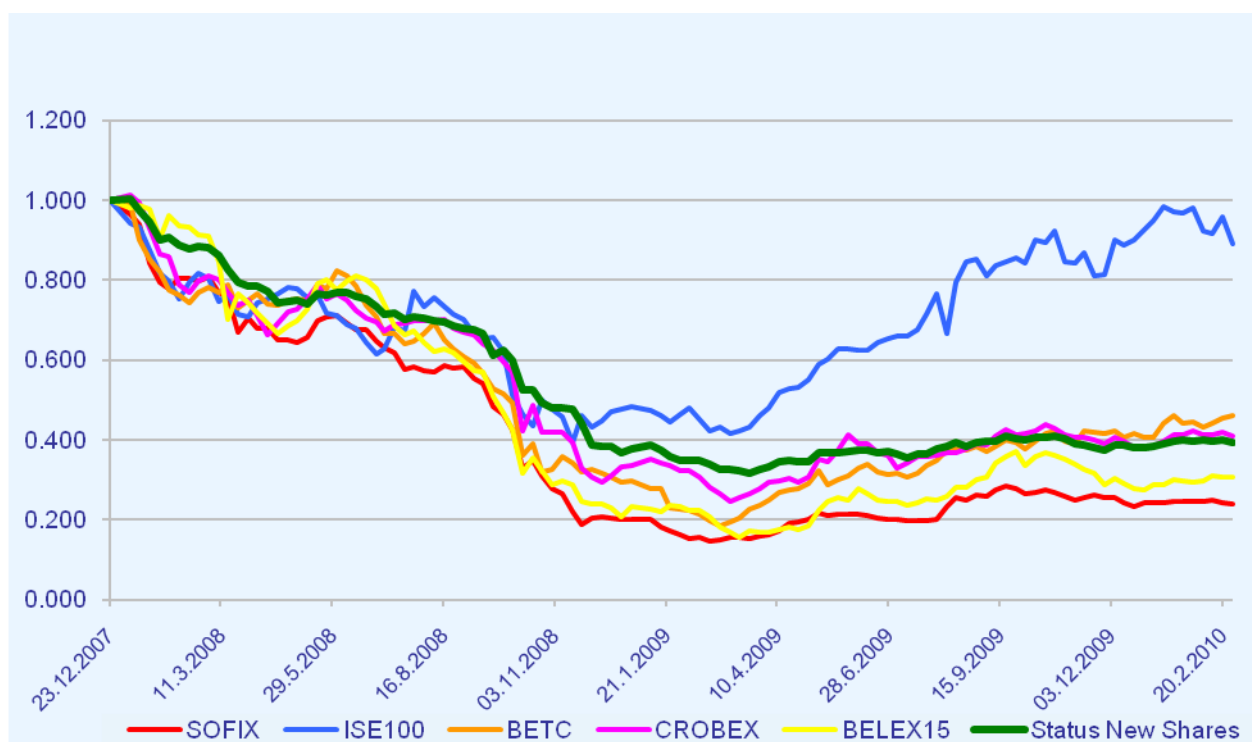
От представените данни се вижда, че стандартното отклонение на цената на ДФ Статус Нови Акции, като измерител на риска, е по-ниско от това на всеки един пазарен индекс по отделно, и от стандартното отклонение на служебния бенчмарк, измерен като средна стойност от измененията на седмична база на петте пазара, в които инвестира фонда. От данните се вижда, че за дадения период регионалната диверсификация като цяло води до по-добри съотношения риск доходност, особено в по-дългосрочен период. Изоставане на доходността на ДФ Статус Нови Акции спрямо служебния бенчмарк от една страна се дължи на по-ниския дял на турските акции в портфейла средно за периода. От друга страна инвестициите ни в Хърватска и България са с относително по-ниска корелация с движението на съответните индекси за по-голямата част от периода.

След намаляването на дефанзивните позиции в България и Хърватска движението на портфейла на фонда спрямо бенчмарка до голяма степен се синхронизира през последните два месеца. С

допълнителното увеличаване на по-агресивни позиции смятаме, че корелацията с индекса ще достигне средните за последните години стойности.

През месец февруари основното позитивно развитие за портфейла на ДФ Статус Нови Акции дойде от инвестициите ни в Сърбия и Румъния, в синхрон с представянето на тези пазари. В същото време пазарът в Турция задълбочи корекцията си от началото на годината. Това бе и пазара който допринесе за отрицателната доходност на фонда за февруари. Политическата нестабилност около задържането на висши офицери натеза и на индексите в Турция, поради опасения за възможни по-сериозни сътресения между ръководството на армията и на управляващата партия. При предходни подобни случаи не е било рядкост да се достига и до предсрочни избори в Турция. В настоящата ситуация по-вероятният изход изглежда да бъде постепенно намаляване на напрежението, без голям отзвук върху управлението на страната. Въпреки тези очаквания, при ескалация на политическо напрежение смятаме да намалим експозицията в Турция.

Обща промяна на петте индекса при база 31/12/2007



През месец февруари бяха направени следните сделки с ценни книжа:

Сделки с ценни книжа:

Покупки	Брой
Konchar Electroindustrija D.D.	350

Продажби	Брой
Aerostar S.A. Bacau	21500
Gosha FOM	3
Златен лев холдинг АД	2934
София Комерс -зложни къщи АД	107
Унипак АД	200

Обем и структура на инвестициите в портфейла

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

Активи	30.11.2009	31.12.2009	31.01.2010	28.02.2010	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	2 680 552	2 646 785	2 785 608	2 819 715	79.24%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	231 715	323 901	315 961	232 893	6.54%
Депозити до 3 мес.	493 383	499 511	500 002	500 494	14.06%
Вземания	5 584	1 380	3 391	5 186	0.15%
Общо:	3 411 233	3 471 578	3 604 961	3 558 472	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ "Статус Нови Акции" акции

Дружество	31.01.2010			28.02.2010			Процент от активите
	Брой ценни книжа	Цена за брой	Балансова стойност	Брой ценни книжа	Цена за брой	Балансова стойност	
Акции България							
Албена инвест холдинг	5317	6.010	31955	5317	5.862	31168	0.88%
Златен лев холдинг АД	28701	0.570	16360	28701	0.451	12944	0.36%

Софарма АД - София	3321	4.072	13523	3321	4.010	13317	0.37%
София Комерс - заложни къщи АД	37150	3.738	138867	37033	4.001	148169	4.16%
Унипак АД	21829	3.720	81204	21729	3.500	76052	2.14%
ЦКБ АД	14351	1.313	18843	14351	1.274	18283	0.51%
ПЪРВА ИНВЕСТИЦИОННА БАНКА АД	6000	2.472	14832	6000	2.411	14466	0.41%
Индустириален Холдинг България АД	10000	1.629	16290	10000	1.420	14200	0.40%
Монбат АД	3000	6.305	18915	3000	6.476	19428	0.55%
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	282929	0.579	163816	282929	0.590	166928	4.69%
ФОНД ЗА НЕДВИЖИМИ ИМОТИ БЪЛГАРИЯ АДСИЦ	10000	0.380	3800	10000	0.370	3700	0.10%
ДФ ДСК РАСТЕЖ	255038	0.766	195471	255038	0.764	194961	5.48%
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.585	87371	149450	0.585	87371	2.46%
MAUNTIN PARADAIS INVEST ADSIC	150000	0.970	145518	150000	0.970	145518	4.09%
Общо:			946764			946505	26.60%
Акции Хърватска							
Atlanska Plovitba D.D. DUBROVNIK				100	267.44	26744	0.75%
Konchar Electroindustrija D.D.	195	137.70	26851	545	125.81	68565	1.93%
Konchar Transformatori	206	548.11	112911	206	564.52	116292	3.27%
Duro Dakovic holding	1000	9.58	9583	1000	10.60	10605	0.30%
ULJANIK PLOVIDBA D.D.	174	172.06	29938	174	166.67	29000	0.81%
Institut IGH d.d	20	755.86	15117	20	787.64	15753	0.44%
INA	31	508.01	15748	31	488.45	15142	0.43%
Общо:			210148			282101	7.93%
Акции Румъния							

CNTEE TRANSELECTRICA SA	8275	7.670	63469	8275	8.176	67657	1.90%
Oil Terminal Constanta	199400	0.122	24318	199400	0.133	26540	0.75%
SNO - Santierul Naval Orsova	17700	2.906	51436	17700	2.852	50482	1.42%
SIF MOLDOVA BACAU	234000	0.629	147148	234000	0.665	155725	4.38%
SIF OLTENIA CRAIOVA	115000	0.734	84369	115000	0.756	86918	2.44%
SIF Banat Crisana /SIF 1/	65000	0.634	41184	65000	0.675	43875	1.23%
SIF Transilvania /SIF 3/	158800	0.374	59386	158800	0.397	63031	1.77%
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	12400	7.003	86837	12400	7.035	87236	2.45%
Aerostar S.A. Bacau	79400	0.291	23074	57900	0.333	19266	0.54%
Farmaceutica Remedia SA	104000	0.076	7927	104000	0.075	7811	0.22%
Общо			589149			608541	17.10%
Акции Сърбия							
Agrobanka a.d. Beograd	120	171.82	20619	120	179.54	21545	0.61%
AIK banka a.d. Niš	2557	52.56	134395	2557	57.05	145865	4.10%
ALFA PLAM a.d. Vranje	266	160.42	42672	266	170.78	45428	1.28%
Veterinarski zavod AD	3017	11.18	33740	3017	12.98	39147	1.10%
RTC LUKA LEGET A.D.	223	52.56	11720	223	51.94	11583	0.33%
Novosadski sajam a.d. Novi Sad	1949	32.78	63879	1949	34.85	67921	1.91%
Gosha FOM	1810	13.11	23729	1807	13.74	24830	0.70%
Jedinstvo AD	42	119.18	5006	42	121.51	5103	0.14%
Univezal banka A.D	8	138.05	1104	8	130.05	1040	0.03%
Общо			316246			362462	10.19%
Акции Турция							
Koc Holding	27600	4.80	132402	27600	4.28	118154	3.32%

Haci Omer Sabanci Holding	16888	6.11	103254	16888	5.44	91942	2.58%
T. Garanti Bankasi	20000	5.97	119459	20000	5.30	106093	2.98%
Turkcell	15000	10.35	155202	15000	8.42	126334	3.55%
Akbank	15500	8.28	128300	15500	7.26	112514	3.16%
Общо			638616			555038	15.60%
Акции Македония							
Инново Статус Акции	51535	1.24	64066	51535	1.26	65068	1.83%
Общо:			2785608			2819715	79.24%

Хеджиращи сделки

Не са сключвани хеджиращи сделки и няма отворена хеджираща позиция.

Дата на съставяне:

09.03.2010 г.

Съставили:

Иван Иванов:

Мария Сивкова: