

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 01.9.2011 г. до 30.9.2011 г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на септември 2011 г. нетната стойност на активите на фонда е 3 210 413.5800 лева, което представлява намаление от 139 584.38 лева спрямо края на август. За същия период дяловете в обращение намаляват с 13 856.5524 и достигат до 5 089 759.1866 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	Q2 2010	Q3 2010	Q4 2010	Q 1 2011	Q2 2011	Q3 2011	Септември 2011
SOFIX	-10.9%	3.8%	-8.41%	22.93%	-7.11%	-16.13%	-8.23%
CROBEX	-13.4%	3.3%	-2.41%	8.50%	-2.60%	-16.87%	-8.83%
BELEX 15	-7.4%	-2.2%	2.38%	16.43%	-1.44%	-26.11%	-12.67%
BET-C	-20.3%	10.6%	-0.14%	13.28%	-6.02%	-20.05%	-9.23%
ISE 100	-3.00%	19.9%	4.54%	-2.38%	-1.81%	-5.65%	10.65%
DFNEW	-8.87%	6.71%	1.94%	2.02%	-5.3%	-13.90%	-3.90%
Средно аритметично за индексите	-11.0%	7.1%	-0.81%	11.75%	-3.79%	-16.96%	-5.66%
Дял на съответната държава от активите на фонда	30.06.2010	30.09.2010	31.12.2010	31.03.2011	30.06.2011	31.09.2011	
България	24.02%	20.77%	19.96%	22.06%	22.76%	22.45%	
Хърватска	9.07%	8.25%	8.63%	10.25%	11.35%	10.92%	
Сърбия и Македония	11.19%	9.92%	9.09%	10.17%	8.65%	7.22%	
Румъния	11.49%	13.63%	11.17%	15.89%	13.32%	14.36%	
Турция	27.51%	30.26%	27.45%	21.36%	21.14%	23.20%	

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

Индекс	Стандартно отклонение	Изменение 12 месеца	Изменение 24 месеца
SOFIX	17.64%	-10.36%	-27.73%
CROBEX	17.14%	-3.19%	-15.61%
BELEX 15	18.68%	-10.96%	-33.08%
BET-C	17.47%	-14.66%	-0.36%
ISE 100	24.04%	-9.25%	24.59%
Служебен бенчмарк	13.1%	-9.68%	-10.44%
DFNEW	12.48%	-17.23%	-17.93%

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

Движение на цената на фонда спрямо служебния бенчмарк



През септември се запази напрежението около начина за справяне с дълговата криза в еврозоната. Разнопосочните сигнали от политици за това как планират да се справят с проблемите допълнително увеличава несигурността на пазарите, като опасността от прехвърляне на кризата и върху банковия сектор в Европа нарастна. Наличието на сигнали за намаляваща ликвидност на междубанковия пазар и бягството към сигурност на значителни по обем капитали оказва сериозен натиск върху глобалните пазари.

Подобно негативно развитие увеличава шансовете и за глобална криза, подобна на тази след фалита на Лемън Брадърс. Разбира се има и немалко различия. Към момента основният проблем е свързан с държавни облигации, които е много по-лесно да бъдат оценявани от синтетичните инструменти, от които тръгна първата криза. Правителствата, макар и да действат мудро и нерешително към момента, вече имат опит в справянето с подобни ликвидни кризи. Въпреки това е трудно да се очаква пазарен ръст без ясен и достатъчно адекватен сценарий за справяне с дълговите проблеми и пресичане на възможността от заразяване на световната икономика

Макар че проблемите са в еврозоната, а страните от югоизточна Европа биха били заразени по-скоро от вторичните последиствия от подобна криза, влиянието върху пазарите на Балканите са потенциално изключително значими. Тази нарастваща несигурност доведе и до натиска надолу на пазарите от региона, макар и по-слаб отколкото предполага разликата в рисковия профил между пазарите от югоизточна Европа и развитите пазари.

Доходност по месеци	Средно аритметично за индексите	DFNEW
Септември 2010	3.35%	2.52%
Октомври 2010	-0.81%	1.94%
Ноември 2010	-2.04%	-4.62%
Декември 2010	5.05%	2.28%
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%

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	30.6.2011	31.7.2011	31.8.2011	30.9.2011	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	3 041 176	2 930 117	2 710 418	2 509 765	78.15%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	70 013	57 783	10 031	80 211	2.50%
Депозити до 3 мес.	800 444	802 177	622 264	609 134	18.97%
Вземания	25 650	22 333	16 799	11 753	0.37%
Разходи за бъдещи периоди	879	918	732	552	0.02%
Общо:	3 938 162	3 813 327	3 360 244	3 211 415	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ "Статус Нови Акции" акции

Дружество	31.8.2011			30.9.2011			
	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	6.18	32832	5317	6.53	34693	1.08%
Софарма АД - София	3321	3.46	11491	3321	3.30	10946	0.34%
София Комерс - заложни къщи АД	9097	5.48	49879	9097	5.70	51853	1.61%
Индуриален Холдинг България АД	23333	0.82	19133	23333	0.72	16683	0.52%
Индуриален Холдинг България АД - права				23333	0.001	23	0.00%
М+С ХИДРАВЛИК АД	3830	8.390	32134	3830	8.16	31253	0.97%
ТРЕЙС ГРУП ХОЛД АД	452	6.95	3139	452	6.60	2982	0.09%
ТРЕЙС ГРУП ХОЛД АД блокирани	4520	8.07	36476	4520	8.07	36476	1.14%
ПЛОВДИВ ЮРИЙ ГАГАРИН БТ	265	36.99	9802	265	32.942	8730	0.27%

ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	282929	0.645	182489	282929	0.67	189562	5.90%
ДФ ДСК РАСТЕЖ	255038	0.73	187302	255038	0.71	181862	5.66%
ДФ ОБЩИНСКА БАНКА - ПЕРСПЕКТИВА	4274	12.11	51760	4274	12.12	51792	1.61%
ДФ ОБЩИНСКА БАНКА - БАЛАНСИРАН	1690	12.33	20839	1690	12.35	20870	0.65%
АДВАНС ТЕРАФОНД АДСИЦ - СОФИЯ	3300	1.38	4564	3300	1.35	4458	0.14%
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.53	78634	149450	0.53	78634	2.45%
MAUNTIN PARADIS INVEST ADSIC	150000	0.91	136554				
Общо:			857029			720818	22.45%
Акции Хърватска							
Adris P-A	560	57.49	32193	560	52.94	29647	0.92%
Atlanska Plovitba D.D. DUBROVNIK	230	136.77	31457	230	116.31	26752	0.83%
Duro Dakovic holding	1000	15.79	15786	1000	14.87	14865	0.46%
DALEKOVOD D.D.	550	49.91	27450	550	44.08	24242	0.75%
Institut IGH d.d	20	329.72	6594	20	268.36	5367	0.17%
Konchar Transformatori	412	322.98	133066	412	286.87	118192	3.68%
Konchar Electroindustrija D.D.	844	146.37	123539	844	133.53	112697	3.51%
ULJANIK PLOVIDBA D.D.	174	128.56	22370	174	109.53	19059	0.59%
Общо:			392456			350822	10.92%
Акции Румъния							
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	12400	5.55	68767	12400	4.94	61222	1.91%
CNTEE TRANSELECTRICA SA	8275	8.90	73616	8275	7.73	63958	1.99%
SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/	550000	0.21	114456	550000	0.20	109854	3.42%
SIF Banat Crisana /SIF 1/	65000	0.39	25533	65000	0.37	24186	0.75%

SIF MOLDOVA BACAU	234000	0.42	97543	234000	0.38	88539	2.76%
SIF OLTENIA CRAIOVA	185000	0.48	88147	185000	0.44	80794	2.52%
Farmaceutica Remedia SA	104000	0.08	8171	104000	0.08	8407	0.26%
SNO - Santierul Naval Orsova	17700	1.43	25358	17700	1.36	24151	0.75%
Общо			501591			461112	14.36%
Акции Сърбия							
Agrobanka a.d. Beograd	132	108.97	14385	132	88.13	11633	0.36%
AIK banka a.d. Niš	2673	44.11	117905	2673	37.12	99212	3.09%
ALFA PLAM a.d. Vranje	266	154.03	40971	266	151.75	40366	1.26%
Jedinstvo AD	42	107.82	4528	42	105.90	4448	0.14%
RTC LUKA LEGET A.D.	223	55.92	12470	223	56.15	12521	0.39%
Novosadski sajam a.d. Novi Sad	1951	21.10	41162	1951	21.18	41329	1.29%
Veterinarski zavod AD	3017	7.87	23758	3017	7.44	22454	0.70%
Общо			255179			231964	7.22%
Акции Турция							
Akbank	20666	5.03	103976	20666	5.72	118198	3.68%
AK ENERJI SHS	26457	2.81	74460	26457	2.23	58961	1.84%
Enka Insaat Ve Sanayi AS	15554	3.06	47565	15554	3.30	51388	1.60%
T. Garanti Bankasi	20000	4.92	98424	20000	5.74	114700	3.57%
İŞ BANKASI (C)	16800	3.47	58243	16800	3.72	62443	1.94%
Koc Holding	27600	4.80	132354	27600	5.49	151405	4.71%
Haci Omer Sabanci Holding	16888	4.78	80720	16888	5.08	85799	2.67%
Turkcell	15000	5.99	89855	15000	6.81	102155	3.18%
Общо			685598			745050	23.20%

Акции Македония							
Инново Статус Акции	17535	1.06	18565				
Общо:			2710418			2509765	78.15%

Хеджиращи сделки

Не са сключвани хеджиращи сделки и няма отворена хеджираща позиция.

Дата на съставяне:

10.10.2011 г.

Съставили:

Иван Иванов:

Мария Сивкова: