

## **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 01.2.2012 г. до 29.2.2012 г.**

### Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на февруари 2012 г. нетната стойност на активите на фонда е 4 138 581.20 лева, което представлява увеличение от 381 108.86 лева спрямо края на януари. За същия период дяловете в обращение се увеличават с 444 428.6824 и достигат до 6 472 715.4792 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.

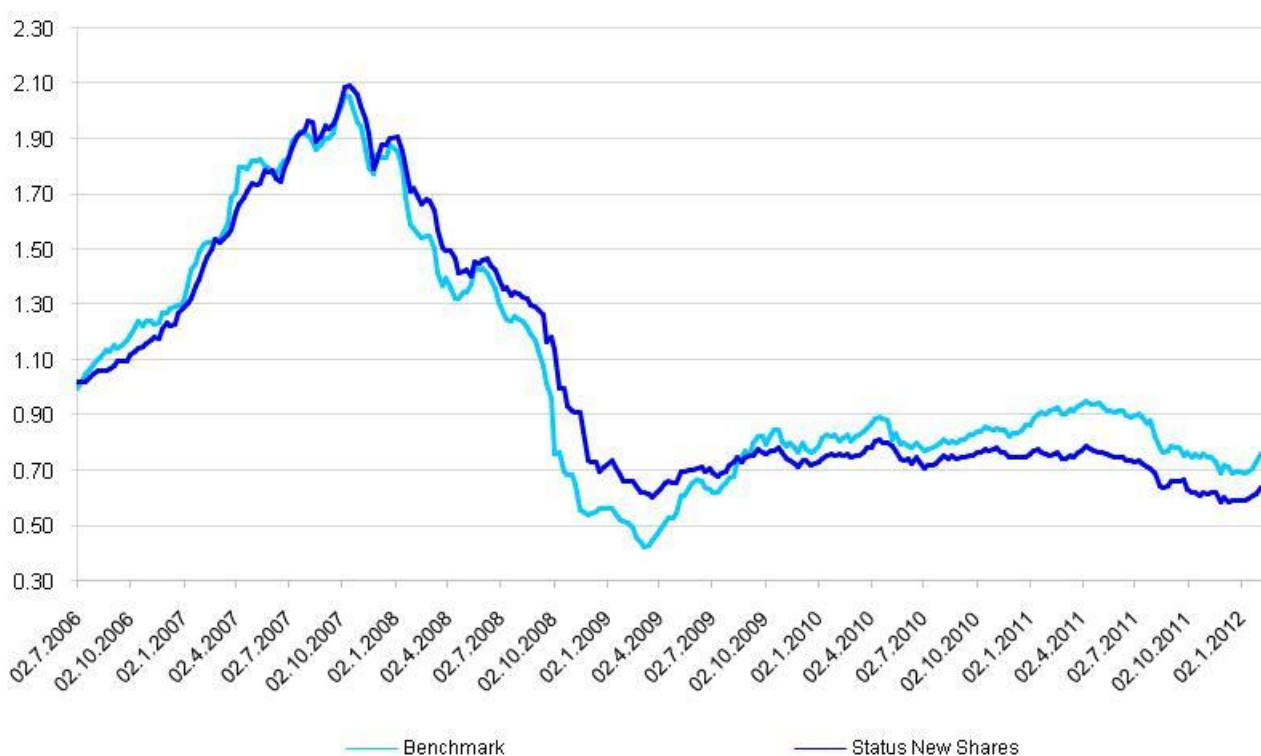
Изменение	Q4 2010	Q 1 2011	Q2 2011	Q3 2011	Q4 2011	Януари 2012	Февруари 2012
SOFIX	-8.41%	22.93%	-7.11%	-16.13%	-7.18%	0.24%	-2.91%
CROBEX	-2.41%	8.50%	-2.60%	-16.87%	-6.16%	-0.74%	3.47%
BELEX 15	2.38%	16.43%	-1.44%	-26.11%	-9.71%	0.19%	9.77%
BET-C	-0.14%	13.28%	-6.02%	-20.05%	-1.01%	10.67%	6.97%
ISE 100	4.54%	-2.38%	-1.81%	-5.65%	-14.12%	11.52%	6.21%
<b>DFNEW</b>	<b>1.94%</b>	<b>2.02%</b>	<b>-5.3%</b>	<b>-13.90%</b>	<b>-6.36%</b>	<b>5.52%</b>	<b>2.58%</b>
Средно аритметично за индексите	-0.81%	11.75%	-3.79%	-16.96%	-7.63%	4.38%	4.70%
<b>Дял на съответната държава от активите на фонда</b>	<b>31.12.2010</b>	<b>31.03.2011</b>	<b>30.06.2011</b>	<b>30.09.2011</b>	<b>31.12.2011</b>	<b>31.01.2012</b>	<b>29.02.2012</b>
България	19.96%	22.06%	22.76%	22.45%	16.05%	16.22%	16.33%
Хърватска	8.63%	10.25%	11.35%	10.92%	9.27%	8.39%	8.22%
Сърбия и Македония	9.09%	10.17%	8.65%	7.22%	5.61%	5.30%	4.84%
Румъния	11.17%	15.89%	13.32%	14.36%	17.78%	19.33%	22.77%
Турция	27.45%	21.36%	21.14%	23.20%	21.93%	24.33%	23.85%

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

Индекс	Стандартно отклонение	Изменение 12 месеца	Изменение 24 месеца
SOFIX	13.08%	-30.32%	-26.03%
CROBEX	14.73%	-20.25%	-16.41%
BELEX 15	20.00%	-28.14%	-22.27%
BET-C	19.54%	-9.05%	1.30%
ISE 100	26.09%	-0.92%	22.16%
Служебен бенчмарк	15.2%	-17.74%	-8.25%
<b>DFNEW</b>	14.42%	-14.51%	-14.31%

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

### Движение на цената на фонда спрямо служебния бенчмарк



През февруари продължи подобряването на капиталовите пазари започнало в началото на годината. В края на месеца ЕЦБ осъществи и втората част от програмата си за дългосрочно кредитиране на банките като и този път банките взеха почти 530 милиарда евро, което значително увеличи ликвидността в банковата система в Еврозоната. Действията на ЕЦБ намалиха значително и усещането за риск, свързан с държавните дългове. През февруари доходността на италианските десет годишни облигации падна от 6% в края на януари до 5,19% към края на февруари. И вече е значително под върховите си стойности от над 7% в началото на годината. Постепенното решаване и на въпроса с гръцкия дълг също въздейства позитивно, макар че едва ли може да се очаква, че сделката за замяната на гръцките облигации и отписването на част от дълга ще подобри бързо състоянието на гръцката икономика и държавни финанси. От другата страна на Атлантика, Американската икономика вече показва устойчиво увеличение на заетостта и дава надежда, че повторното и връщане към рецесия няма да се състои.

През февруари увеличихме дела на акциите до 79,6% като спрямо ноември увеличението е над 10 пункта. Смятаме, че рисковете от значително влошаване както на икономиките на държавите от Югоизточна Европа, така и на финансовите им пазари в краткосрочен период вече са минимални и подържането на значителен процент от активите на фонда в депозити и кеш няма да бъде оправдано съобразно инвестиционния фокус на фонда. През февруари увеличихме дела на инвестираните в България, Румъния и Турция средства

Доходност по месеци	Средно аритметично за индексите	DFNEW
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%
Февруари 2012	4.70%	2.58%

**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	30.11.2011	31.12.2011	31.1.2012	29.2.2012	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	2 573 802	2 496 058	2 772 115	3 306 895	79.63%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	548 550	167 984	122 879	20 560	0.50%
Депозити до 3 мес.	610 264	867 795	868 624	818 354	19.71%
Вземания	6 089	1 804	4 514	6 516	0.16%
Разходи за бъдещи периоди	186	0	297	251	0.01%
<b>Общо:</b>	<b>3 738 891</b>	<b>3 533 642</b>	<b>3 768 429</b>	<b>4 152 576</b>	<b>100.00%</b>

#### Стойност на притежаваните от ДФ “Статус Нови Акции” акции

	31.1.2012			29.2.2012			
Дружество	Брой ценни книжа	Цена за брой	Балансова стойност	Брой ценни книжа	Цена за брой	Балансова стойност	Процент от активите
<b>Акции България</b>							
Албена инвест холдинг	5317	5.62	29871	5317	5.14	27303	0.66%
Софарма АД - София	3321	3.01	10003	3321	2.74	9093	0.22%
София Комерс - заложни къщи АД	9097	5.54	50352	9097	5.50	50034	1.20%
Индустриален Холдинг България АД	23333	0.65	15260	23333	0.64	14956	0.36%
М+С ХИДРАВЛИК АД	3830	7.214	27630	3830	6.981	26737	0.64%
ТРЕЙС ГРУП ХОЛД АД	4972	3.47	17263	4972	3.27	16248	0.39%
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	282929	0.55	155611	282929	0.48	134391	3.24%
ДФ ДСК РАСТЕЖ	255038	0.66	169151	255038	0.65	165249	3.98%
АДВАНС ТЕРАФОНД АДСИЦ - СОФИЯ	3300	1.45	4785	47300	1.564	73977	1.78%
ЕЛАРГ ФОНД ЗА ЗЕМЕДЕЛСКА ЗЕМЯ АДСИЦ	23168	1.21	27941	23168	1.22	28172	0.68%
ФЕЪРПЛЕЙ ПРОПЪРТИ АДСИЦ	93100	0.28	25975	93100	0.27	25509	0.61%
ФОНД ЗА НЕДВИЖИМИ ИМОТИ БЪЛГАРИЯ АДСИЦ				40100	0.73	29393	0.71%
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.52	77254	149450	0.52	77254	1.86%
Общо:			611095			678318	16.33%
<b>Акции Хърватска</b>							
Adris P-A	560	57.22	32043	560	55.54	31104	0.75%
Atlanska Plovitba D.D. DUBROVNIK	230	77.95	17928	230	85.22	19601	0.47%
Duro Dakovic holding	1000	14.44	14440	1000	17.82	17818	0.43%
DALEKOVOD D.D.	550	30.45	16750	550	35.92	19756	0.48%
Institut IGH d.d	20	217.31	4346	20	258.23	5165	0.12%

Konchar Transformatori	412	268.40	110582	412	296.96	122349	2.95%
Konchar Electroindustrija D.D.	844	124.43	105023	844	130.02	109740	2.64%
ULJANIK PLOVIDBA D.D.	183	82.90	15171	183	86.25	15784	0.38%
<b>Общо:</b>			<b>316284</b>			<b>341316</b>	<b>8.22%</b>
<b>Акции Румъния</b>							
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	12400	4.96	61443	12400	4.87	60344	1.45%
CNTEE TRANSELECTRICA SA	8275	8.11	67097	8275	7.82	64722	1.56%
SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/	880000	0.22	195033	1180000	0.25	297733	7.17%
SIF Banat Crisana /SIF 1/	125000	0.44	54619	125000	0.54	67970	1.64%
SIF MOLDOVA BACAU	234000	0.59	138613	234000	0.64	149131	3.59%
SIF OLTENIA CRAIOVA	335000	0.54	181841	335000	0.64	213198	5.13%
SIF Transilvania				200000	0.30	60853	1.47%
Farmaceutica Remedia SA	104000	0.09	9744	104000	0.10	10712	0.26%
SNO - Santierul Naval Orsova	17700	1.13	19933	17700	1.17	20698	0.50%
<b>Общо</b>			<b>728324</b>			<b>945359</b>	<b>22.77%</b>
<b>Акции Сърбия</b>							
Agrobanka a.d. Beograd	132	27.99	3695	132	32.91	4344	0.10%
AIK banka a.d. Niš	2673	32.99	88182	2673	34.33	91761	2.21%
ALFA PLAM a.d. Vranje	266	141.99	37770	266	127.80	33995	0.82%
Jedinstvo AD	42	84.83	3563	42	85.20	3578	0.09%
RTC LUKA LEGET A.D.	223	53.56	11944	223	51.55	11496	0.28%
Novosadski sajam a.d. Novi Sad	1951	18.81	36697	1951	19.45	37948	0.91%
Veterinarski zavod AD	3017	5.90	17803	3017	5.95	17940	0.43%

Общо			199653			201063	4.84%
<b>Акции Турция</b>							
Akbank	20666	5.87	121275	20666	5.69	117552	2.83%
AK ENERJI SHS	26457	1.74	45912	26457	1.85	48987	1.18%
Enka Insaat Ve Sanayi AS	15554	4.02	62589	15554	4.09	63566	1.53%
T. Garanti Bankasi	20000	5.55	110995	34500	5.47	188761	4.55%
İŞ BANKASI (C)	16800	3.19	53660	16800	3.39	56888	1.37%
Koc Holding	33100	5.75	190357	33100	5.97	197665	4.76%
Haci Omer Sabanci Holding	16888	5.62	94857	16888	6.21	104795	2.52%
TURK TRAKTOR				18000	7.44	133914	3.22%
TAV HAVALIMANLARI	18000	6.69	120418	2500	31.36	78400	1.89%
Turkcell	15000	7.78	116696	15000	7.92	118851	2.86%
YAPI VE KREDI BANKASI				11500	2.74	31460	0.76%
Общо			916760			990528	23.85%
Общо:			2772115			3306895	79.63%

### 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:**

09.3.2012 г.

**Съставил:**

Иван Иванов: