

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 01.11.2011 г. до 30.11.2011 г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на ноември 2011 г. нетната стойност на активите на фонда е 3 728 106.07 лева, което представлява намаление от 381 525.19 лева спрямо края на октомври. За същия период дяловете в обращение намаляват с 330 047.0761 и достигат до 6 291 033.2229 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.

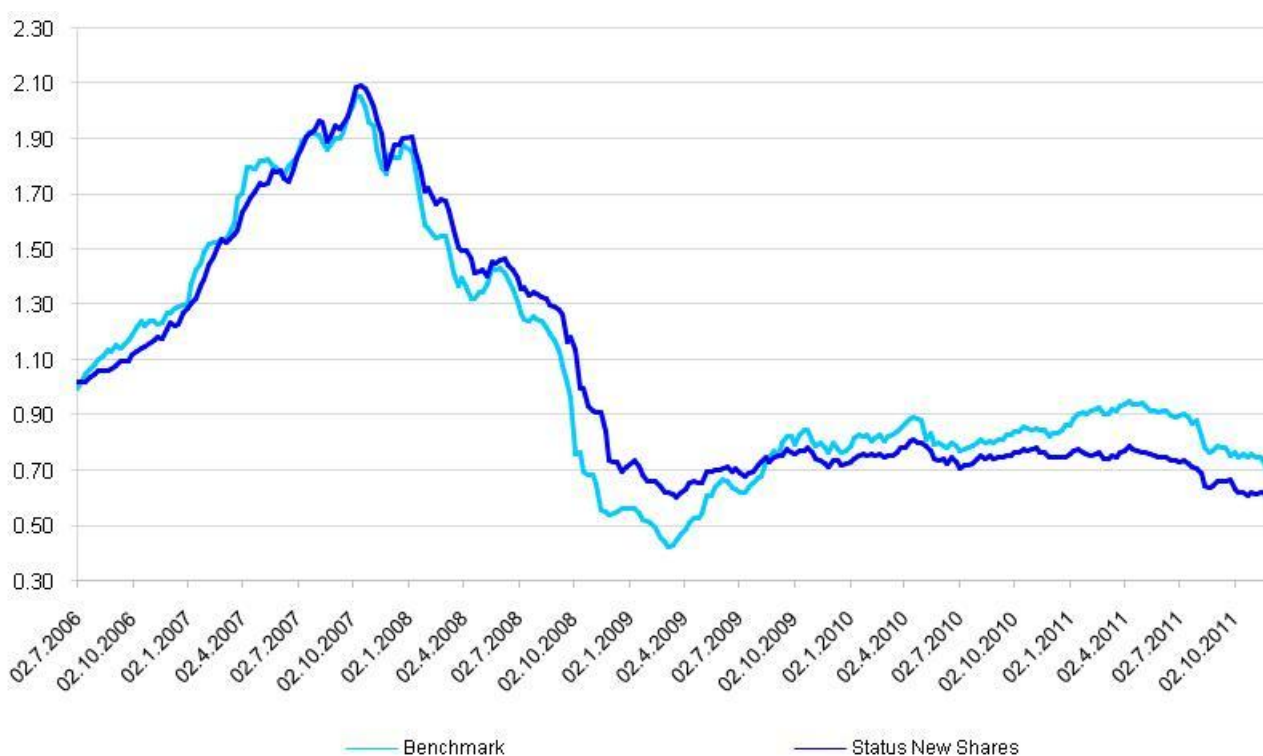
Изменение	Q2 2010	Q3 2010	Q4 2010	Q 1 2011	Q2 2011	Q3 2011	Ноември 2011
SOFIX	-10.9%	3.8%	-8.41%	22.93%	-7.11%	-16.13%	-9.60%
CROBEX	-13.4%	3.3%	-2.41%	8.50%	-2.60%	-16.87%	-5.61%
BELEX 15	-7.4%	-2.2%	2.38%	16.43%	-1.44%	-26.11%	-9.98%
BET-C	-20.3%	10.6%	-0.14%	13.28%	-6.02%	-20.05%	-7.50%
ISE 100	-3.00%	19.9%	4.54%	-2.38%	-1.81%	-5.65%	-2.75%
DFNEW	-8.87%	6.71%	1.94%	2.02%	-5.3%	-13.90%	-4.53%
Средно аритметично за индексите	-11.0%	7.1%	-0.81%	11.75%	-3.79%	-16.96%	-7.09%
Дял на съответната държава от активите на фонда	30.06.2010	30.09.2010	31.12.2010	31.03.2011	30.06.2011	30.09.2011	30.11.2011
България	24.02%	20.77%	19.96%	22.06%	22.76%	22.45%	17.89%
Хърватска	9.07%	8.25%	8.63%	10.25%	11.35%	10.92%	8.56%
Сърбия и Македония	11.19%	9.92%	9.09%	10.17%	8.65%	7.22%	5.60%
Румъния	11.49%	13.63%	11.17%	15.89%	13.32%	14.36%	15.80%
Турция	27.51%	30.26%	27.45%	21.36%	21.14%	23.20%	20.98%

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

Индекс	Стандартно отклонение	Изменение 12 месеца	Изменение 24 месеца
SOFIX	16.04%	-13.29%	-31.63%
CROBEX	18.38%	-2.68%	-15.86%
BELEX 15	19.48%	-24.20%	-27.84%
BET-C	18.77%	-13.65%	5.37%
ISE 100	25.21%	-16.58%	20.22%
Служебен бенчмарк	14.6%	-14.08%	-9.95%
DFNEW	13.56%	-20.03%	-17.08%

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

Движение на цената на фонда спрямо служебния бенчмарк



През ноември дълговата криза в Европа достигна опасна точка. Лихвите по дългосрочните облигации на Италия преминаха 7%, същевременно се увеличи доходността и на испанските, френските и дори немските облигации. По този начин кризата започнала в периферията на Еврозоната се придвижи вече и до сърцето на Европа. Пазарите в дадени моменти през месеца се намираха на границата на паника, като само намесата на ЕЦБ за лимитирано изкупуване на италиански облигации успяваше да върне пазара в по-спокойно състояние. Проблемът с увеличаваща се доходност на държавните облигации на вторичен пазар е свързан с това че тези високи лихви се пренасят и на първичния пазар, или с други думи директно влияят на цената, на която държавите се финансират. Повишението на цената на финансиране създава напрежение за това до колко държавите от южна Европа и особено Италия ще успеят да рефинансират падежите през следващата година на своите ДЦК. В същото време това, че ЕЦБ (за разлика от Федералния резерв и от Английската централна банка) не купува ДЦК на първичен пазар създава сериозни съмнения в разглежданите до момента като безрискови италиански ценни книжа. Преминаването на над 1,9 трилиона дълг от категорията на безрисков в рисков води след себе си

значителни последици за всички държачи подобни ДЦК, като това в особена степен се отнася до банките. Банките са и пътя на евентуално финансово заразяване към Франция и дори Германия.

Макар че проблемите са в Евророната, а страните от югоизточна Европа биха били заразени по-скоро от вторичните последствия 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. Поради тази увеличена несигурност, и през ноември поддържахме по-ниско ниво на инвестициите в акции спрямо нормалното за фонда. Минимално увеличихме инвестициите в Турция и в Румъния, като по този начин достигнахме до 68,8% от активите инвестирани в акции.

По-консервативната политика на инвестиране на фонда доведе и до по-сериозна разлика в представянето на портфейла на ДФ Нови Акции, спрямо представянето на индексите.

Доходност по месеци	Средно аритметично за индексите	DFNEW
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%
Октомври.11	-0.78%	-1.60%
Ноември.11	-7.09%	-4.53%

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	31.8.2011	30.9.2011	31.10.2011	30.11.2011	Структура на активите спрямо общата им стойност /%I
Акции и права	2 710 418	2 509 765	2 471 312	2 573 802	68.84%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	10 031	80 211	1 042 108	548 550	14.67%
Депозити до 3 мес.	622 264	609 134	609 761	610 264	16.32%
Вземания	16 799	11 753	3 913	6 089	0.16%
Разходи за бъдещи периоди	732	552	366	186	0.00%
Общо:	3 360 244	3 211 415	4 127 460	3 738 891	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “Статус Нови Акции” акции

Дружество	31.10.2011			30.11.2011			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	6.60	35092	5317	5.99	31844	0.85%
Софарма АД - София	3321	3.28	10906	3321	3.19	10594	0.28%
София Комерс - заложни къщи АД	9097	5.99	54491	9097	5.48	49852	1.33%
Индустриален Холдинг България АД	23333	0.70	16403	23333	0.59	13743	0.37%
М+С ХИДРАВЛИК АД	3830	8.095	31004	3830	6.697	25650	0.69%
ТРЕЙС ГРУП ХОЛД АД	4972	5.01	24925	4972	3.26	16204	0.43%
ПЛОВДИВ ЮРИЙ ГАГАРИН БТ	265	33.49	8874				
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	282929	0.72	203709	282929	0.66	186733	4.99%
ДФ ДСК РАСТЕЖ	255038	0.703	179220	255038	0.66	167279	4.47%
ДФ ОБЩИНСКА БАНКА - ПЕРСПЕКТИВА	4274	12.17	52015	4274	12.212	52200	1.40%
ДФ ОБЩИНСКА БАНКА - БАЛАНСИРАН	1690	12.41	20977	1690	12.46	21067	0.56%
АДВАНС ТЕРАФОНД АДСИЦ - СОФИЯ	3300	1.34	4422	3300	1.27	4204	0.11%
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.52	77254	149450	0.60	89670	2.40%
Общо:			719292			669039	17.89%
Акции Хърватска							
Adris P-A	560	57.13	31992	560	53.96	30219	0.81%
Atlanska Plovitba D.D. DUBROVNIK	230	108.00	24840	230	87.86	20207	0.54%
Duro Dakovic holding	1000	13.05	13047	1000	11.90	11900	0.32%
DALEKOVOD D.D.	550	38.61	21236	550	33.89	18639	0.50%
Institut IGH d.d	20	237.40	4748	20	207.12	4142	0.11%

Konchar Transformatori	412	292.19	120381	412	271.12	111700	2.99%
Konchar Electroindustrija D.D.	844	133.83	112955	844	125.17	105644	2.83%
ULJANIK PLOVIDBA D.D.	183	104.08	19046	183	97.09	17768	0.48%
Общо:			348245			320220	8.56%
Акции Румъния							
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	12400	5.18	64172	12400	4.58	56822	1.52%
CNTEE TRANSELECTRICA SA	8275	8.21	67952	8275	7.44	61563	1.65%
SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/	550000	0.21	112911	880000	0.19	167231	4.47%
SIF Banat Crisana /SIF 1/	65000	0.35	22875	65000	0.39	25405	0.68%
SIF MOLDOVA BACAU	234000	0.36	84991	234000	0.41	95034	2.54%
SIF OLTENIA CRAIOVA	185000	0.42	78254	335000	0.46	153510	4.11%
Farmaceutica Remedia SA	104000	0.09	9178	104000	0.09	9765	0.26%
SNO - Santierul Naval Orsova	17700	1.35	23958	17700	1.21	21470	0.57%
Общо			464292			590800	15.80%
Акции Сърбия							
Agrobanka a.d. Beograd	132	78.58	10372	132	64.95	8574	0.23%
AIK banka a.d. Niš	2673	34.61	92504	2673	28.23	75472	2.02%
ALFA PLAM a.d. Vranje	266	154.74	41160	266	135.44	36026	0.96%
Jedinstvo AD	42	103.14	4332	42	95.26	4001	0.11%
RTC LUKA LEGET A.D.	223	56.53	12606	223	54.63	12183	0.33%
Novosadski sajam a.d. Novi Sad	1951	21.33	41612	1951	27.84	54316	1.45%
Veterinarski zavod AD	3017	7.03	21199	3017	6.21	18728	0.50%
Общо			223785			209300	5.60%

Акции Турция							
Akbank	20666	5.27	108934	20666	4.89	101122	2.70%
AK ENERJI SHS	26457	2.22	58775	26457	1.61	42662	1.14%
Enka Insaat Ve Sanayi AS	15554	3.62	56351	15554	3.46	53869	1.44%
T. Garanti Bankasi	20000	5.06	101283	20000	4.73	94686	2.53%
İŞ BANKASI (C)	16800	3.38	56718	16800	2.85	47908	1.28%
Koc Holding	27600	5.21	143726	33100	4.61	152498	4.08%
Haci Omer Sabanci Holding	16888	4.94	83372	16888	4.40	74318	1.99%
TAV HAVALIMANLARI				18000	6.13	110382	2.95%
Turkcell	15000	7.10	106538	15000	7.13	106998	2.86%
Общо			715698			784442	20.98%
Общо:			2471312			2573802	68.84%

Хеджиращи сделки

Не са сключвани хеджиращи сделки и няма отворена хеджираща позиция.

Дата на съставяне:

09.12.2011 г.

Съставили:

Иван Иванов:

Мария Сивкова: