

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 01.01.2010 г. до 31.01.2010 г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на януари 2010 г. нетната стойност на активите е 3 587 815.24 лева, което представлява увеличение от 117 851.78 лева спрямо края на декември. За същият период дяловете в обръщение намаляват с -3470.0206 и достигат до 4743350.6882. 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.

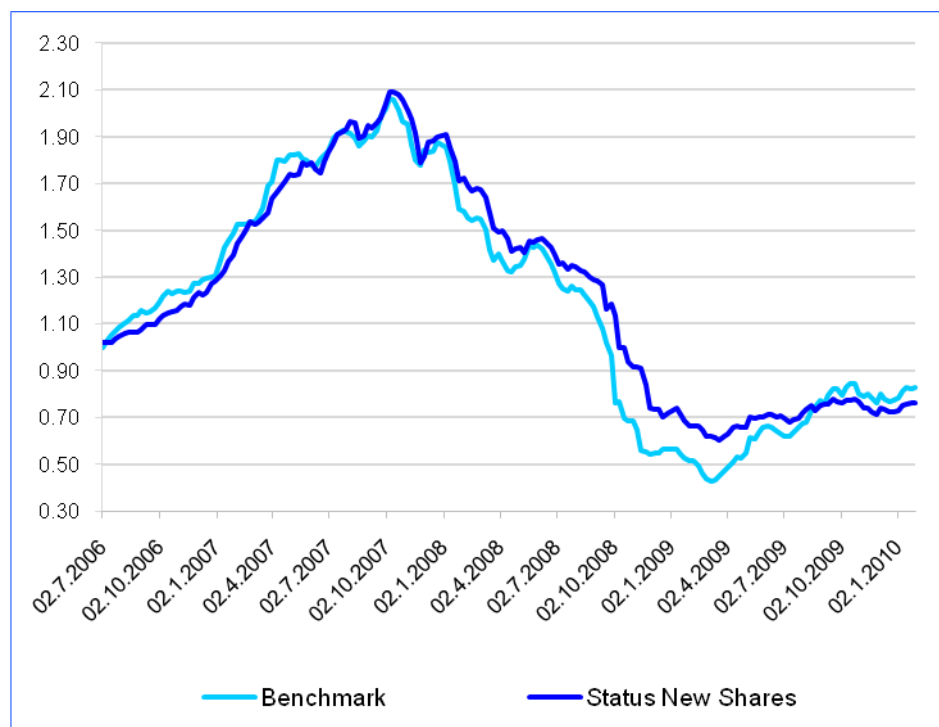
Изменение	Q4 2008	Q1 2009	Q2 2009	Q3 2009	Q4 2009	Януари 2010
SOFIX	-54.7%	-22.4%	28.2%	34.6%	-11.01%	1.93%
CROBEX	-42.6%	-15.4%	30.7%	15.9%	-8.80%	9.95%
BELEX 15	-43.7%	-32.6%	49.5%	45.1%	-19.64%	2.23%
BET-C	-38.9%	-21.6%	35.7%	26.3%	2.14%	9.28%
ISE 100	-25.5%	-4.1%	43.0%	30.0%	10.26%	3.46%
DFNEW	-37.10%	-19.2%	15.5%	8.3%	-4.89%	4.24%
Средно аритметично за индексите	-41.1%	-17.65%	37.4%	30.4%	-5.41%	5.37%
Дял на съответната държава от активите на фонда	31.12.2008	31.03.2009	30.06.2009	30.09.2009	31.12.2009	31.01.2010
България	34.31%	40.19%	32.26%	27.33%	27.40%	26.26%
Хърватска	12.06%	12.22%	11.36%	10.92%	5.72%	5.83%
Сърбия и Македония	17.14%	12.55%	12.29%	12.49%	11.27%	11.12%
Румъния	8.60%	9.07%	9.42%	10.32%	14.36%	16.34%
Турция	8.70%	11.13%	15.05%	14.87%	16.92%	17.71%

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

Индекс	Стандартно отклонение	Изменение 12 месеца	Изменение 24 месеца
SOFIX	30.85%	51.85%	-68.97%
CROBEX	32.70%	35.93%	-51.00%
BELEX 15	43.70%	26.37%	-68.59%
BET-C	33.83%	96.39%	-42.59%
ISE 100	35.38%	110.73%	27.99%
Служебен бенчмарк	25.2%	64.25%	-40.63%
DFNEW	14.47%	13.82%	-55.76%

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

Движение на цената на фонда спрямо служебния бенчмарк

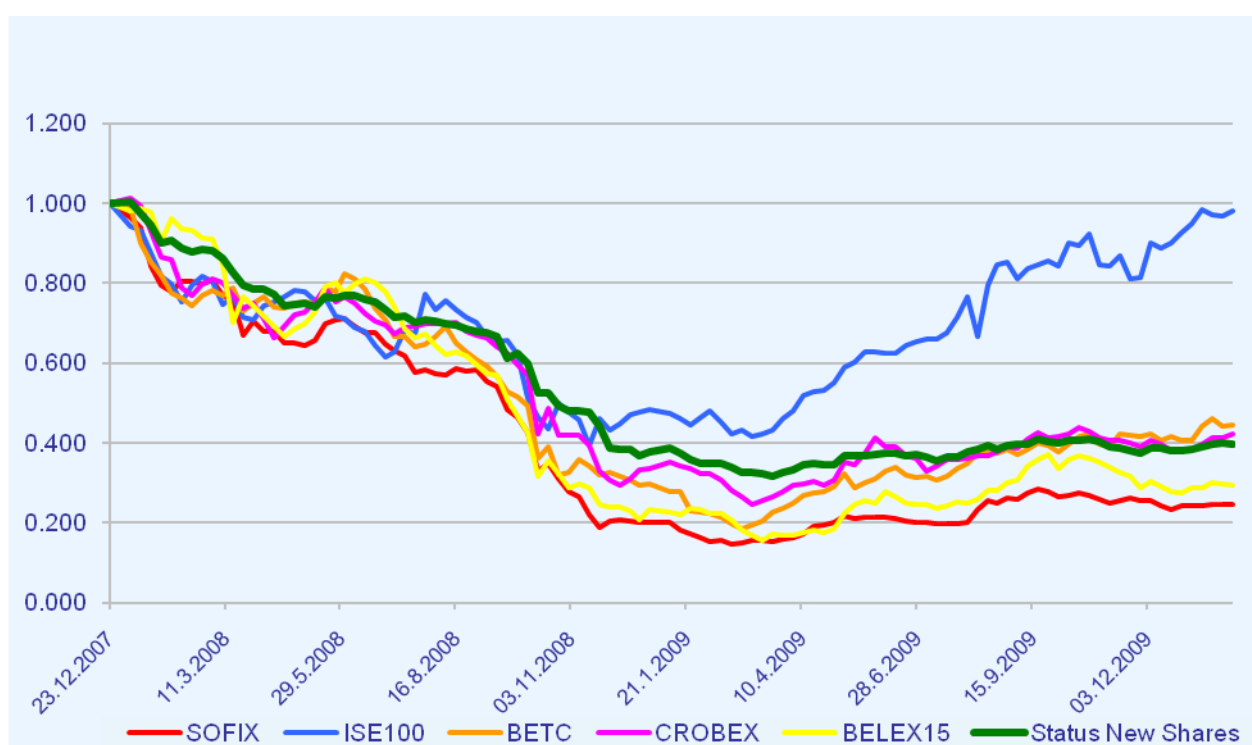


От представените данни се вижда, че стандартното отклонение на цената на ДФ Статус Нови Акции, като измерител на риска, е по-ниско от това на всеки един пазарен индекс по отделно, и от стандартното отклонение на служебния бенчмарк, измерен като средна стойност от измененията на седмична база на петте 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.

Смятаме че през първата половина на 2010 г. ще премине най-тежката чест от икономическата криза на Балканите. Като влиянието на влошената икономическа среда върху отделните компании постепенно ще започне да намалява. Вече би могло, с относителна малка вероятност за грешка, да се определят конкретното и проявление в отделните сектори и компании. Като това дава възможност за структуриране на портфейла на ДФ Статус Нови Акции според тези икономически реалности.

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



През месец януари бяха направени следните сделки с ценни книжа:

Сделки с ценни книжа:

Покупки	Брой
Монбат АД	3000
Atlanska Plovitba D.D. DUBROVNIK	100

Продажби	Брой
Златен лев холдинг АД	1000
Novosadski sajam a.d. Novi Sad	10
София Комерс -заложни къщи АД	4048

Обем и структура на инвестициите в портфейла

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

Активи	31.10.2009	30.11.2009	31.12.2009	31.01.2010	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	2 911 856	2 680 552	2 646 785	2 785 608	77.27%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	266 893	231 715	323 901	315 961	8.76%
Депозити до 3 мес.	492 776	493 383	499 511	500 002	13.87%
Вземания	6 903	5 584	1 380	3 391	0.09%
Общо:	3 678 429	3 411 233	3 471 578	3 604 961	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ "Статус Нови Акции" акции

Дружество	31.12.2009			31.01.2010			
	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	6.044	32136	5317	6.010	31955	0.89%
Златен лев холдинг АД	29701	0.505	14999	28701	0.570	16360	0.45%
Софарма АД - София	3321	3.916	13005	3321	4.072	13523	0.38%
София Комерс - заложни къщи АД	41188	3.700	152396	37150	3.738	138867	3.85%
Унипак АД	21829	3.720	81204	21829	3.720	81204	2.25%
ЦКБ АД	14351	1.291	18527	14351	1.313	18843	0.52%

ПЪРВА ИНВЕСТИЦИОННА БАНКА АД	6000	2.276	13656	6000	2.472	14832	0.41%
Индустриален Холдинг България АД	10000	1.747	17470	10000	1.629	16290	0.45%
Монбат АД				3000	6.305	18915	0.52%
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	282929	0.610	172587	282929	0.579	163816	4.54%
ФОНД ЗА НЕДВИЖИМИ ИМОТИ БЪЛГАРИЯ АДСИЦ	10000	0.372	3720	10000	0.380	3800	0.11%
ДФ ДСК РАСТЕЖ	255038	0.770	196395	255038	0.766	195471	5.42%
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.598	89440	149450	0.585	87371	2.42%
MAUNTIN PARADIS INVEST ADSIC	150000	0.970	145518	150000	0.970	145518	4.04%
Общо:			951052			946764	26.26%
Акции Хърватска							
Konchar Electroindustrija D.D.	195	115.10	22445	195	137.70	26851	0.74%
Konchar Transformatori	206	535.09	110229	206	548.11	112911	3.13%
Duro Dakovic holding	1000	9.72	9725	1000	9.58	9583	0.27%
ULJANIK PLOVIDBA D.D.	174	165.12	28732	174	172.06	29938	0.83%
Institut IGH d.d	20	693.29	13866	20	755.86	15117	0.42%
INA	31	441.67	13692	31	508.01	15748	0.44%
Общо:			198688			210148	5.83%
Акции Румъния							
CNTEE TRANSELECTRICA SA	8275	6.238	51622	8275	7.670	63469	1.76%
Oil Terminal Constanta	199400	0.111	22114	199400	0.122	24318	0.67%
SNO - Santierul Naval Orsova	17700	2.611	46212	17700	2.906	51436	1.43%
SIF MOLDOVA BACAU	234000	0.527	123269	234000	0.629	147148	4.08%
SIF OLTENIA CRAIOVA	115000	0.587	67489	115000	0.734	84369	2.34%

SIF Banat Crisana /SIF 1/	65000	0.522	33941	65000	0.634	41184	1.14%
SIF Transilvania /SIF 3/	158800	0.314	49899	158800	0.374	59386	1.65%
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	12400	6.007	74490	12400	7.003	86837	2.41%
Aerostar S.A. Bacau	79400	0.275	21831	79400	0.291	23074	0.64%
Farmaceutica Remedia SA	104000	0.073	7545	104000	0.076	7927	0.22%
Общо			498414			589149	16.34%
Акции Сърбия							
Agrobanka a.d. Beograd	120	166.09	19931	120	171.82	20619	0.57%
AIK banka a.d. Niš	2557	50.42	128927	2557	52.56	134395	3.73%
ALFA PLAM a.d. Vranje	266	173.15	46058	266	160.42	42672	1.18%
Veterinarski zavod AD	3017	11.63	35076	3017	11.18	33740	0.94%
RTC LUKA LEGET A.D.	223	47.42	10575	223	52.56	11720	0.33%
Novosadski sajam a.d. Novi Sad	1963	37.73	74072	1949	32.78	63879	1.77%
Gosha FOM	1810	13.46	24366	1810	13.11	23729	0.66%
Jedinstvo AD	42	122.38	5140	42	119.18	5006	0.14%
Univezal banka A.D	8	159.14	1273	8	138.05	1104	0.03%
Общо			325487			316246	8.77%
Акции Турция							
Koc Holding	27600	3.99	110003	27600	4.80	132402	3.67%
Haci Omer Sabanci Holding	16888	5.18	87562	16888	6.11	103254	2.86%
T. Garanti Bankasi	20000	5.73	114518	20000	5.97	119459	3.31%
Turkcell	15000	9.56	143373	15000	10.35	155202	4.31%
Akbank	15500	8.52	132079	15500	8.28	128300	3.56%
Общо			587536			638616	17.71%
Акции Македония							

Инново Статус Акции	51535	1.27	65677	51535	1.24	64066	1.78%
Общо:			2646785			2785608	77.27%

Хеджиращи сделки

Не са сключвани хеджиращи сделки и няма отворена хеджираща позиция.

Дата на съставяне:

09.02.2010 г.

Съставили:

Иван Иванов:

Мария Сивкова: