

## **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 01.12.2009 г. до 31.12.2009 г.**

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

Към края на декември 2009 г. нетната стойност на активите е 3 469 963.4600 лева, което представлява увеличение от 60 026.57 лева спрямо края на ноември. За същият период дяловете в обръщение намаляват с -24 091.8839 и достигат до 4 746 820.7088. 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	Q3.2008	Q4 2008	Q1 2009	Q2 2009	Q3 2009	Q4 2009	Декември 2009
SOFIX	-31.3%	-54.7%	-22.4%	28.2%	34.6%	-11.01%	-5.42%
CROBEX	-16.6%	-42.6%	-15.4%	30.7%	15.9%	-8.80%	-3.04%
BELEX 15	-43.7%	-43.7%	-32.6%	49.5%	45.1%	-19.64%	-2.56%
BET-C	-30.2%	-38.9%	-21.6%	35.7%	26.3%	2.14%	-2.40%
ISE 100	2.74%	-25.5%	-4.1%	43.0%	30.0%	10.26%	16.48%
<b>DFNEW</b>	<b>-17.0%</b>	<b>-37.10%</b>	<b>-19.2%</b>	<b>15.5%</b>	<b>8.3%</b>	<b>-4.89%</b>	<b>2.28%</b>
<b>Средно аритметично за индексите</b>	<b>-23.8%</b>	<b>-41.1%</b>	<b>-17.65%</b>	<b>37.4%</b>	<b>30.4%</b>	<b>-5.41%</b>	<b>0.61%</b>
<b>Дял на съответната държава от активите на фонда</b>	<b>30.09.2008</b>	<b>31.12.2008</b>	<b>31.03.2009</b>	<b>30.06.2009</b>	<b>30.09.2009</b>	<b>30.11.2009</b>	<b>31.12.2009</b>
България	32.24%	34.31%	40.19%	32.26%	27.33%	27.52%	27.40%
Хърватска	14.37%	12.06%	12.22%	11.36%	10.92%	10.01%	5.72%
Сърбия и Македония	15.98%	17.14%	12.55%	12.29%	12.49%	12.25%	11.27%
Румъния	10.14%	8.60%	9.07%	9.42%	10.32%	14.26%	14.36%
Турция	7.52%	8.70%	11.13%	15.05%	14.87%	13.93%	16.92%

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

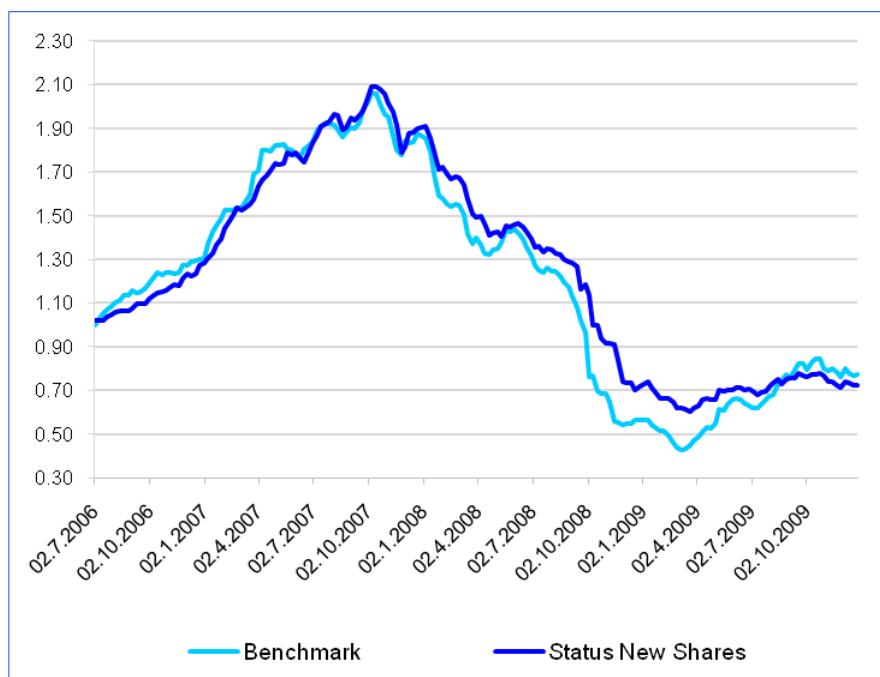
Индекс	Стандартно отклонение	Изменение 12 месеца	Изменение 24 месеца
SOFIX	32.76%	19.13%	-75.83%
CROBEX	33.18%	16.81%	-61.75%
BELEX 15	46.25%	17.44%	-71.37%
BET-C	38.33%	37.31%	-59.27%
ISE 100	35.95%	96.64%	-4.89%
<b>Служебен бенчмарк</b>	26.16%	37.47%	-54.62%
<b>DFNEW</b>	16.09%	-0.66%	-62.10%

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. През декември значително намалихме дефанзивните позиции в Хърватска и продължаваме постепенното заместване на дефанзивни с по-агресивни позиции в България.

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.

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

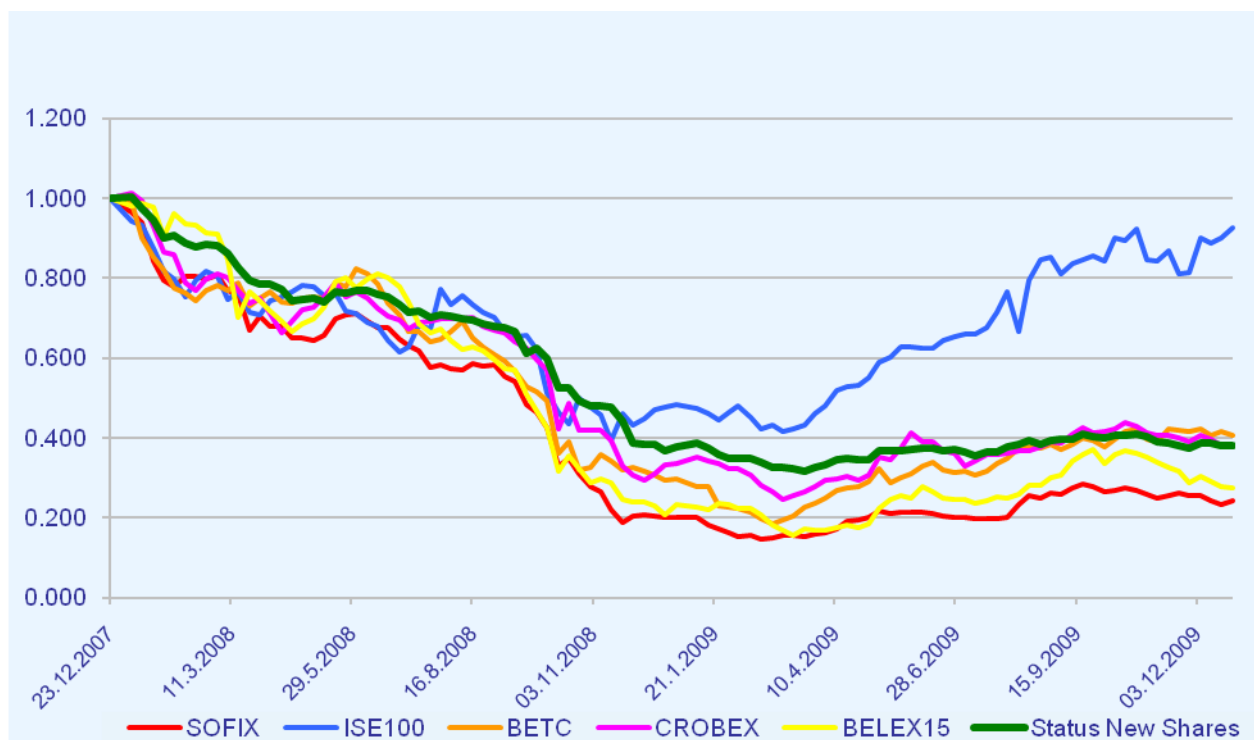
## Движение на цената на фонда спрямо служебния бенчмарк



Корекцията, започнала на повечето пазари от Югоизточна Европа от септември продължи и през декември. Въпреки че голяма част от развитите икономики показват ясни признаци за излизане от рецесията, това позитивно развитие все още не се прехвърля върху страните от Югоизточна Европа, както що се отнася до конкретно влияние върху макро икономическите показатели, така и до фондовите пазари. Очакванията, че реално възстановяване на темповете на растеж ще настъпи през първата половина на следващата година, охлажда за момента и апетита за риск на пазарните участници. Все още не се наблюдава и ясно подобрене в отчетите на мнозинството от водещи компании от региона. Поради силната зависимост на експортните отрасли от възстановяване на търсенето на търговските им партньори, предимно в Западна Европа, то може да се очаква известен лаг в растежа на корпоративните продажби и печалби.

Въпреки растежите, които реализираха от началото на годината, пазарите от региона – без Турция – остават под натиск, като що се отнася до компенсиране на загубите от началото на кризата се намират на доста по-ниско равнище спрямо развитите западни пазари.

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



През месец декември бяха направени следните сделки с ценни книжа:

#### Сделки с ценни книжа:

Покупки	Брой
Индустриален Холдинг България АД	10000
Софарма АД - София	3321

Продажби	Брой
FIMA Proprius	18164
Novosadski sajam a.d. Novi Sad	4
SUNCE FABRIKA ULJA A.D.	88
Златен лев холдинг АД	6500
София Комерс -заложни къщи АД	925
Унипак АД	74

## Обем и структура на инвестициите в портфейла

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

Активи	30.09.2009	31.10.2009	30.11.2009	31.12.2009	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	2 909 199	2 911 856	2 680 552	2 646 785	76.24%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	290 632	266 893	231 715	323 901	9.33%
Депозити до 3 мес.	492 294	492 776	493 383	499 511	14.39%
Вземания	9 965	6 903	5 584	1 380	0.04%
<b>Общо:</b>	<b>3 702 089</b>	<b>3 678 429</b>	<b>3 411 233</b>	<b>3 471 578</b>	<b>100.00%</b>

### Стойност на притежаваните от ДФ "Статус Нови Акции" акции

Дружество	30.11.2009			31.12.2009			
	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	6.212	33029.204	5317	6.044	32136	0.93%
Златен лев холдинг АД	36201	0.573	20743.173	29701	0.505	14999	0.43%
Софарма АД - София				3321	3.916	13005	0.37%
София Комерс - заложни къщи АД	42113	3.65	153712.45	41188	3.700	152396	4.39%
Унипак АД	21903	3.777	82727.631	21829	3.720	81204	2.34%
ЦКБ АД	14351	1.45	20808.95	14351	1.291	18527	0.53%
ПЪРВА ИНВЕСТИЦИОННА БАНКА АД	6000	2.674	16044	6000	2.276	13656	0.39%
Индустриален Холдинг България АД				10000	1.747	17470	0.50%
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	282929	0.61	172586.69	282929	0.610	172587	4.97%

ФОНД ЗА НЕДВИЖИМИ ИМОТИ БЪЛГАРИЯ АДСИЦ	10000	0.378	3780	10000	0.372	3720	0.11%
ДФ ДСК РАСТЕЖ	255038	0.7852	200253.287	255038	0.770	196395	5.66%
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.5985	89440.0769	149450	0.598	89440	2.58%
MAUNTIN PARADAIS INVEST ADSIC	150000	0.9701	145517.928	150000	0.970	145518	4.19%
<b>Общо:</b>			<b>938643.39</b>			<b>951052</b>	<b>27.40%</b>
<b>Акции Хърватска</b>							
FIMA Proprius	18164	6.7	121397.3				
Konchar Electroindustrija D.D.	195	116.3	22677.3	195	115.10	22445	0.65%
Konchar Transformatori	206	614.9	126663.8	206	535.09	110229	3.18%
Duro Dakovic holding	1000	10.2	10212.2	1000	9.72	9725	0.28%
ULJANIK PLOVIDBA D.D.	174	176.4	30700.9	174	165.12	28732	0.83%
Institut IGH d.d	20	803.4	16067.0	20	693.29	13866	0.40%
INA	31	440.1	13642.4	31	441.67	13692	0.39%
<b>Общо:</b>			<b>341360.89</b>			<b>198688</b>	<b>5.72%</b>
<b>Акции Румъния</b>							
CNTEE TRANSELECTRICA SA	8275	5.679	46992.8	8275	6.238	51622	1.49%
Oil Terminal Constanta	199400	0.116	23104.0	199400	0.111	22114	0.64%
SNO - Santierul Naval Orsova	17700	2.565	45394.5	17700	2.611	46212	1.33%
SIF MOLDOVA BACAU	234000	0.499	116811.1	234000	0.527	123269	3.55%
SIF OLTENIA CRAIOVA	115000	0.572	65833.9	115000	0.587	67489	1.94%
SIF Banat Crisana /SIF 1/	65000	0.504	32745.2	65000	0.522	33941	0.98%
SIF Transilvania /SIF 3/	158800	0.309	49090.3	158800	0.314	49899	1.44%
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	12400	6.183	76665.0	12400	6.007	74490	2.15%

Aerostar S.A. Bacau	79400	0.282	22363.4	79400	0.275	21831	0.63%
Farmaceutica Remedia SA	104000	0.071	7382.6	104000	0.073	7545	0.22%
<b>Общо</b>			<b>486382.82</b>			<b>498414</b>	<b>14.36%</b>
<b>Акции Сърбия</b>							
Agrobanka a.d. Beograd	120	178.15	21377.53	120	166.09	19931	0.57%
AIK banka a.d. Niš	2557	52.86	135162.28	2557	50.42	128927	3.71%
ALFA PLAM a.d. Vranje	266	179.57	47765.70	266	173.15	46058	1.33%
Veterinarski zavod AD	3017	12.157	36678.01	3017	11.63	35076	1.01%
SUNCE FABRIKA ULJA A.D.	88	63.985	5630.66				
RTC LUKA LEGET A.D.	223	47.989	10701.46	223	47.42	10575	0.30%
Novosadski sajam a.d. Novi Sad	1963	38.999	76555.41	1963	37.73	74072	2.13%
Gosha FOM	1810	15.48	28019.16	1810	13.46	24366	0.70%
Jedinstvo AD	42	125.8	5283.70	42	122.38	5140	0.15%
Univezal banka A.D	8	144.56	1156.52	8	159.14	1273	0.04%
<b>Общо</b>			<b>368330.43</b>			<b>325487</b>	<b>9.38%</b>
<b>Акции Турция</b>							
Koc Holding	27600	3.18	87854.05	27600	3.99	110003	3.17%
Haci Omer Sabanci Holding	16888	4.55	76897.66	16888	5.18	87562	2.52%
T. Garanti Bankasi	20000	4.43	88514.50	20000	5.73	114518	3.30%
Turkcell	15000	7.57	113621.98	15000	9.56	143373	4.13%
Akbank	15500	6.98	108174.94	15500	8.52	132079	3.80%
<b>Общо</b>			<b>475063.13</b>			<b>587536</b>	<b>16.92%</b>
<b>Акции Македония</b>							
Инново Статус Акции	51534.77	1.3733	70771.33	51535	1.27	65677	1.89%
<b>Общо:</b>			<b>2680552</b>			<b>2646785</b>	<b>76.24%</b>



### **Хеджиращи сделки**

Не са сключвани хеджиращи сделки и няма отворена хеджираща позиция.

**Дата на съставяне:**

08.01.2010 г.

**Съставили:**

Иван Иванов:

Мария Сивкова: