

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 01.5.2011 г. до 31.5.2011 г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на май 2011 г. нетната стойност на активите на фонда е 3 996 956.23 лева, което представлява намаление от 126 730.39 лева спрямо края на април. За същия период дяловете в обращение намаляват със 2 490.90 и достигат до 5 362 706.90. 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.

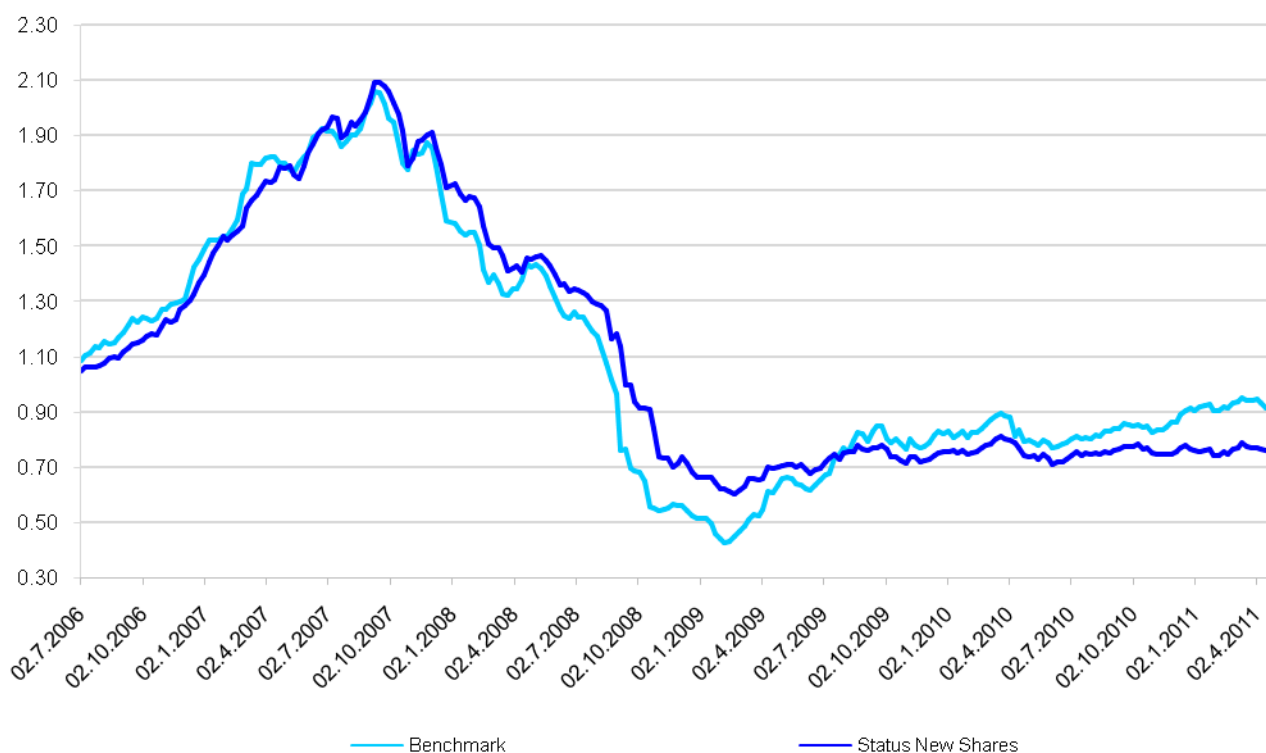
Изменение	Q1 2010	Q2 2010	Q3 2010	Q4 2010	Q 1 2011	Април 2011	Май 2011
SOFIX	-2.0%	-10.9%	3.8%	-8.41%	22.93%	-0.93%	-2.30%
CROBEX	6.9%	-13.4%	3.3%	-2.41%	8.50%	-2.47%	2.01%
BELEX 15	3.2%	-7.4%	-2.2%	2.38%	16.43%	-1.75%	10.66%
BET-C	29.7%	-20.3%	10.6%	-0.14%	13.28%	0.12%	-6.87%
ISE 100	7.0%	-3.00%	19.9%	4.54%	-2.38%	7.47%	-8.96%
DFNEW	7.21%	-8.87%	6.71%	1.94%	2.02%	-0.59%	-3.03%
Средно аритметично за индексите	9.0%	-11.0%	7.1%	-0.81%	11.75%	0.49%	-1.09%
Дял на съответната държава от активите на фонда	31.03.2010	30.06.2010	30.09.2010	31.12.2010	31.03.2011	30.04.2011	31.05.2011
България	24.70%	24.02%	20.77%	19.96%	22.06%	22.76%	23.09%
Хърватска	8.55%	9.07%	8.25%	8.63%	10.25%	10.35%	11.31%
Сърбия и Македония	11.52%	11.19%	9.92%	9.09%	10.17%	9.72%	9.81%
Румъния	17.42%	11.49%	13.63%	11.17%	15.89%	14.69%	13.89%
Турция	23.92%	27.51%	30.26%	27.45%	21.36%	23.03%	20.78%

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

Индекс	Стандартно отклонение	Изменение 12 месеца	Изменение 24 месеца
SOFIX	17.11%	12.96%	13.60%
CROBEX	14.72%	14.72%	6.28%
BELEX 15	15.83%	24.25%	43.91%
BET-C	15.82%	11.30%	59.48%
ISE 100	19.55%	15.93%	80.02%
Служебен бенчмарк	9.3%	15.83%	40.66%
DFNEW	10.34%	0.43%	5.93%

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

Движение на цената на фонда спрямо служебния бенчмарк



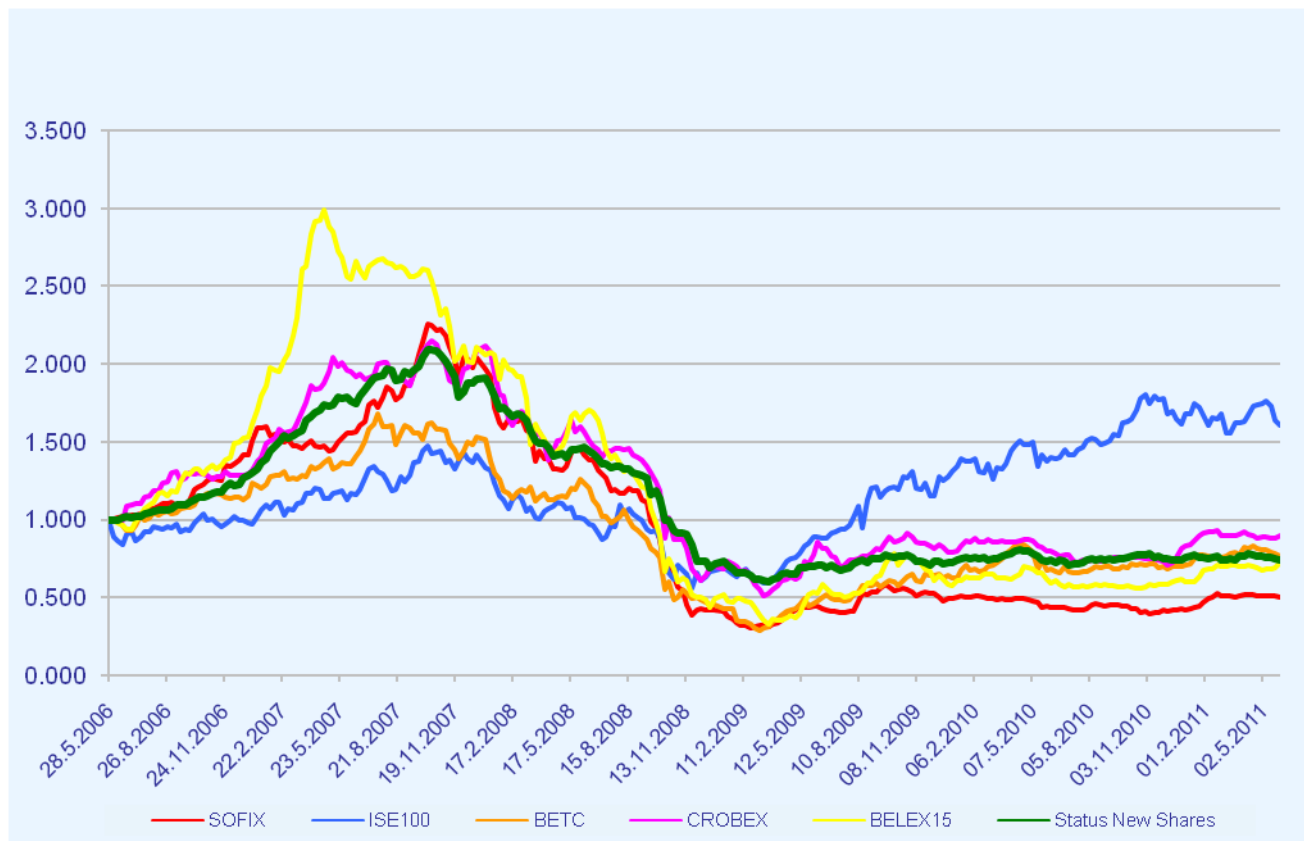
През месец май ликвидните пазари от региона като Румъния и Турция последваха развитите пазари и навлязоха в корекция. В същото време пазарите от бивша Югославия се представиха относително добре, като най-силно бе представянето на сръбския BELEX 15, който се увеличи с над 10%, макар и ръста му да бе повлиян от малка част от включените в него компании. В Хърватска силно се представиха промишлените компании, които имаха и най-висок принос за намаляване на спада на цената на дяловете на Фонда.

С намаляване на волатилността на фондовите пазари през последната година, все по-голямо значение за динамиката на цената на ДФ Статус Нови Акции започват да придобиват валутните курсове. Въпреки това, не смятаме да хеджираме портфейла за предпазване от негативни валутно-курсови разлики. Валутните курсове до голяма степен следват приливите и отливите на чужди инвестиции в държавите от региона и хеджирането на валутната експозиция би туширало голяма част от отразяването на промените в икономическия фундамент.

През месеца намалихме дела на инвестицията ни в Иново Статус.

Доходност по месеци	Средно аритметично за индексите	DFNEW
Февруари 2010	-1.47%	-0.64%
Март 2010	4.94%	5.03%
Април 2010	2.34%	2.08%
Май 2010	-9.96%	-7.20%
Юни 2010	-3.50%	-3.34%
Юли 2010	2.71%	3.50%
Август 2010	0.8%	0.19%
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%

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	28.2.2011	31.3.2011	30.4.2011	31.5.2011	Структура на активите спрямо общата им стойност /%I
Акции и права	3 252 100	3 396 959	3 338 208	3 161 943	78.88%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	87 328	71 298	10 771	23 726	0.59%
Депозити до 3 мес.	776 722	788 610	790 315	792 459	19.77%
Вземания	5 602	2 087	4 115	29 426	0.73%
Разходи за бъдещи периоди	285	1 389	1 221	1 047	0.03%

Общо:	4 122 038	4 260 343	4 144 630	4 008 601	100.00%
-------	-----------	-----------	-----------	-----------	---------

Стойност на притежаваните от ДФ “Статус Нови Акции” акции

Дружество	30.4.2011			30.4.2011			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	6.47	34374	5317	6.54	34768	0.87%
Софарма АД - София	3321	4.47	14845	3321	4.34	14416	0.36%
София Комерс - заложни къщи АД	9097	6.90	62760	9097	6.80	61860	1.54%
Индуриален Холдинг България АД	23333	1.13	26366	23333	1.06	24710	0.62%
М+С ХИДРАВЛИК АД	2830	7.411	20973	2830	7.277	20594	0.51%
НЕОХИМ АД - ДИМИТРОВГРАД	450	41.25	18564	450	39.75	17888	0.45%
ТРЕЙС ГРУП ХОЛД АД	452	91.15	41201	452	83.28	37644	0.94%
ПЛОВДИВ ЮРИЙ ГАГАРИН БТ	400	41.88	16752	265	41.87	11095	0.28%
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	282929	0.747	211348	282929	0.745	210782	5.26%
ДФ ДСК РАСТЕЖ	255038	0.82	208463	255038	0.80	205045	5.12%
ДФ ОБЩИНСКА БАНКА - ПЕРСПЕКТИВА	4274	11.86	50701	4274	11.94	51017	1.27%
ДФ ОБЩИНСКА БАНКА - БАЛАНСИРАН	1690	12.03	20331	1690	12.11	20472	0.51%
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.54	80013	149450	0.53	78634	1.96%
MAUNTIN PARADAIS INVEST ADSIC	150000	0.91	136554	150000	0.91	136554	3.41%
Общо:			943246			925477	23.09%
Акции Хърватска							
Adris P-A	560	70.94	39727	560	70.92	39713	0.99%
Atlanska Plovitba D.D. DUBROVNIK	230	185.98	42776	230	186.49	42894	1.07%

Duro Dakovic holding	1000	9.96	9963	1000	13.39	13391	0.33%
DALEKOVOD D.D.	550	63.90	35143	550	66.98	36839	0.92%
Institut IGH d.d	20	475.57	9511	20	499.07	9981	0.25%
Konchar Transformatori	412	341.18	140566	412	354.60	146096	3.64%
Konchar Electroindustrija D.D.	844	146.68	123797	844	162.07	136784	3.41%
ULJANIK PLOVIDBA D.D.	174	158.08	27506	174	159.18	27697	0.69%
Общо:			428990			453396	11.31%
Акции Румъния							
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	12400	7.19	89207	12400	6.73	83426	2.08%
CNTEE TRANSELECTRICA SA	8275	10.17	84137	8275	10.83	89587	2.23%
Oil Terminal Constanta	199400	0.11	21948	199400	0.11	22485	0.56%
SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/	330000	0.27	88710	330000	0.23	75831	1.89%
SIF Banat Crisana /SIF 1/	65000	0.60	39186	65000	0.49	31567	0.79%
SIF MOLDOVA BACAU	234000	0.68	158241	234000	0.61	141911	3.54%
SIF OLTENIA CRAIOVA	115000	0.75	86593	115000	0.65	74919	1.87%
Farmaceutica Remedia SA	104000	0.10	9976	104000	0.10	10397	0.26%
SNO - Santierul Naval Orsova	17700	1.74	30815	17700	1.52	26836	0.67%
Общо			608812			556959	13.89%
Акции Сърбия							
Agrobanka a.d. Beograd	120	164.92	19790	120	175.27	21033	0.52%
AIK banka a.d. Niš	2557	72.67	185828	2673	71.94	192287	4.80%
ALFA PLAM a.d. Vranje	266	186.50	49608	266	181.49	48275	1.20%
Jedinstvo AD	42	131.53	5524	42	128.00	5376	0.13%

RTC LUKA LEGET A.D.	223	57.02	12715	223	58.57	13062	0.33%
Novosadski sajam a.d. Novi Sad	1949	21.51	41926	1949	22.10	43072	1.07%
Veterinarski zavod AD	3017	10.33	31153	3017	10.49	31639	0.79%
Общо			346545			354744	8.85%
Акции Турция							
Akbank	20666	6.84	141413	20666	6.05	125017	3.12%
AK ENERJI SHS	26457	3.33	87999	26457	3.00	79348	1.98%
Enka Insaat Ve Sanayi AS	13688	5.77	78963	13688	4.87	66710	1.66%
T. Garanti Bankasi	20000	6.83	136510	20000	5.83	116557	2.91%
IŞ BANKASI (C)	16800	4.66	78289	16800	4.13	69423	1.73%
Koc Holding	27600	7.09	195555	27600	5.98	165082	4.12%
Haci Omer Sabanci Holding	16888	7.05	119072	16888	5.86	98997	2.47%
Turkcell	15000	7.78	116674	15000	7.45	111701	2.79%
Общо			954475			832835	20.78%
Акции Македония							
Инново Статус Акции	51535	1.09	56139	34535	1.12	38531	0.96%
Общо:			3338208			3161943	78.88%

Хеджиращи сделки

Не са сключвани хеджиращи сделки и няма отворена хеджираща позиция.

Дата на съставяне:

10.06.2011 г.

Съставили:

Иван Иванов:

Мария Сивкова: