

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 01.11.2009 г. до 30.11.2009 г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на ноември 2009 г. нетната стойност на активите е 3 409 936.8900 лева, което представлява намаление от -257 739.08 лева спрямо края на октомври. За същият период дяловете в обръщение намаляват с -25 606.9498 и достигат до 4 770 912.5927. 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	октомври 2009	ноември 2009
SOFIX	-31.3%	-54.7%	-22.4%	28.2%	34.6%	-4.69%	-1.28%
CROBEX	-16.6%	-42.6%	-15.4%	30.7%	15.9%	-2.4%	-3.6%
BELEX 15	-43.7%	-43.7%	-32.6%	49.5%	45.1%	-2.39%	-15.50%
BET-C	-30.2%	-38.9%	-21.6%	35.7%	26.3%	-0.2%	4.8%
ISE 100	2.74%	-25.5%	-4.1%	43.0%	30.0%	-1.51%	-3.89%
DFNEW	-17.0%	-37.10%	-19.2%	15.5%	8.3%	-0.51%	-6.54%
Средно аритметич но за индексите	-23.8%	-41.1%	-17.65%	37.4%	30.4%	-2.23	-3.89%
Дял на съответна та държава от активите на фонда	30.09.2008	31.12.2008	31.03.2009	30.06.2009	30.09.2009	31.10.2009	30.11.2009
България	32.24%	34.31%	40.19%	32.26%	27.33%	27.63%	27.52%
Хърватска	14.37%	12.06%	12.22%	11.36%	10.92%	12.60%	10.01%
Сърбия и Македония	15.98%	17.14%	12.55%	12.29%	12.49%	12.77%	12.25%
Румъния	10.14%	8.60%	9.07%	9.42%	10.32%	10.94%	14.26%
Турция	7.52%	8.70%	11.13%	15.05%	14.87%	14.44%	13.93%

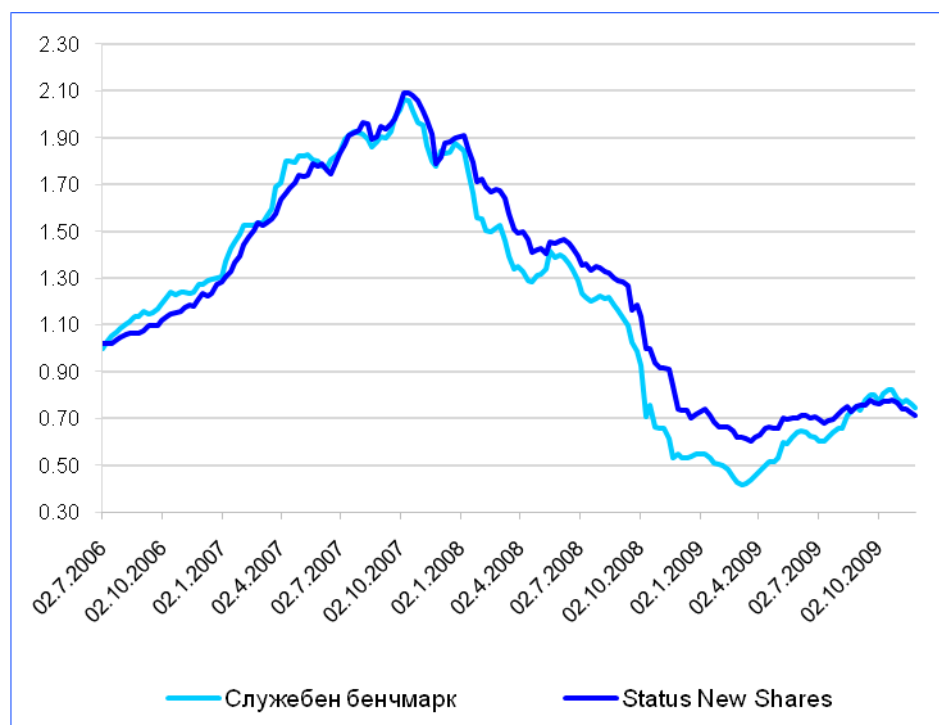
Информация за риск-доходност на ДФ „Статус Нови Акции”

Индекс	Стандартно отклонение	Изменение 12 месеца	Изменение 24 месеца
SOFIX	36.25%	23.7%	-69.4%
CROBEX	34.61%	24.4%	-74.4%
BELEX 15	46.70%	28.6%	-55.6%
BET-C	38.86%	76.4%	-16.1%
ISE 100	39.07%	27.7%	-55.7%
Служебен бенчмарк	26.3%	36.2%	-54.2%
DFNEW	20.22%	-3.13%	-60.71%

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. Това определя и по-значимото разминаване между бенчмарка и фонда през последните 12 месеца спрямо по-дълги периоди.

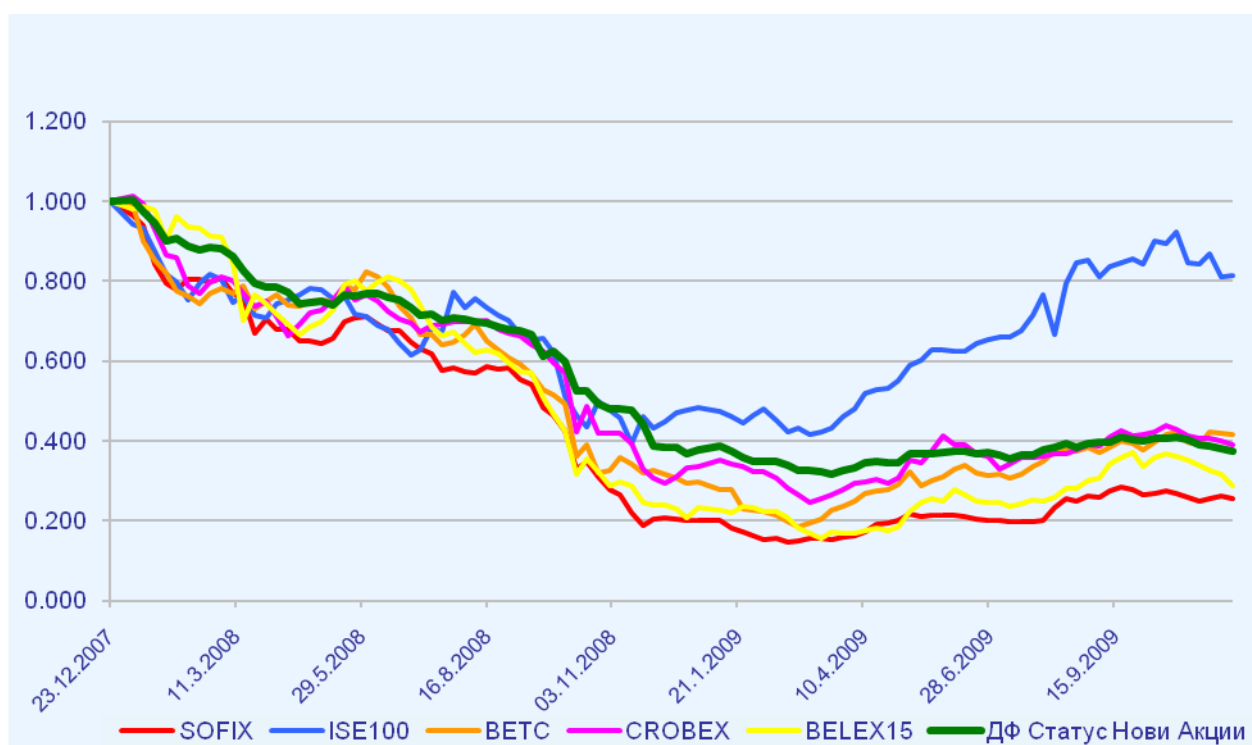
Стандартното отклонение е измерено на седмична база за последните 52 седмици.

Движение на цената на фонда спрямо служебния бенчмарк



Започналата през септември консолидация на пазарите през ноември се превърна в корекция. 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. 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. Проблемите с Дубай бяха една от причините възприемания риск на развиващите се пазари отново да напомни за себе си, като това натисна и котировките на акциите в Югоизточна Европа.

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



През месец ноември бяха направени следните сделки с ценни книжа:

Сделки с ценни книжа:

Покупки	Брой
SIF MOLDOVA BACAU	109000

Продажби	Брой
JADRAN KAMEN	178
Златен лев холдинг АД	10235
София Комерс -заложни къщи АД	288
Унипак АД	200

Обем и структура на инвестициите в портфейла

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

Активи	31.08.2009	30.09.2009	31.10.2009	30.11.2009	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	2 924 152	2 909 199	2 911 856	2 680 552	78.58%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	191 776	290 632	266 893	231 715	6.79%
Депозити до 3 мес.	486 253	492 294	492 776	493 383	14.46%
Вземания	17 181	9 965	6 903	5 584	0.16%
Общо:	3 619 363	3 702 089	3 678 429	3 411 233	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “Статус Нови Акции” акции

Дружество	31.10.2009			30.11.2009			
	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	6.193	32928	5317	6.212	33029.204	0.97%
Златен лев холдинг АД	46436	0.600	27862	36201	0.573	20743.173	0.61%

Инвестор БГ	3615	9.500	34343				
София Комерс - заложни къщи АД	42801	3.805	162858	42113	3.65	153712.45	4.51%
Унипак АД	22103	3.440	76034	21903	3.777	82727.631	2.43%
ЦКБ АД	14351	1.518	21785	14351	1.45	20808.95	0.61%
ПЪРВА ИНВЕСТИЦИОННА БАНКА АД	6000	2.843	17058	6000	2.674	16044	0.47%
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	282929	0.710	200880	282929	0.61	172586.69	5.06%
ФОНД ЗА НЕДВИЖИМИ ИМОТИ БЪЛГАРИЯ АДСИЦ	10000	0.390	3900	10000	0.378	3780	0.11%
ДФ ДСК РАСТЕЖ	255038	0.792	201980	255038	0.7852	200253.287	5.87%
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.598	89440	149450	0.5985	89440.0769	2.62%
MAUNTIN PARADIS INVEST ADSIC	150000	0.982	147300	150000	0.9701	145517.928	4.27%
Общо:			1016367			938643.39	27.63%
Акции Хърватска							
FIMA Proprius	18164	11.31	205405	18164	6.7	121397.3	3.56%
Konchar Electroindustrija D.D.	195	124.72	24320	195	116.3	22677.3	0.66%
Konchar Transformatori	206	638.46	131523	206	614.9	126663.8	3.71%
Duro Dakovic holding	1000	13.26	13256	1000	10.2	10212.2	0.30%
JADRAN KAMEN	178	126.91	22591				
ULJANIK PLOVIDBA D.D.	174	185.47	32271	174	176.4	30700.9	0.90%
Institut IGH d.d	20	987.45	19749	20	803.4	16067.0	0.47%
INA	31	459.91	14257	31	440.1	13642.4	0.40%
Общо:			463373			341360.89	12.60%
Акции Румъния							
CNTEE TRANSELECTRICA SA	8275	5.452	45119	8275	5.679	46992.8	1.38%

Oil Terminal Constanta	199400	0.113	22560	199400	0.116	23104.0	0.68%
SNO - Santierul Naval Orsova	17700	2.726	48254	17700	2.565	45394.5	1.33%
SIF MOLDOVA BACAU	125000	0.441	55092	234000	0.499	116811.1	3.42%
SIF OLTENIA CRAIOVA	115000	0.491	56433	115000	0.572	65833.9	1.93%
SIF Banat Crisana /SIF 1/	65000	0.477	31011	65000	0.504	32745.2	0.96%
SIF Transilvania /SIF 3/	158800	0.286	45457	158800	0.309	49090.3	1.44%
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	12400	5.589	69300	12400	6.183	76665.0	2.25%
Aerostar S.A. Bacau	79400	0.273	21646	79400	0.282	22363.4	0.66%
Farmaceutica Remedia SA	104000	0.073	7561	104000	0.071	7382.6	0.22%
Общо			402432			486382.82	10.94%
Акции Сърбия							
Agrobanka a.d. Beograd	120	239.87	28784	120	178.15	21377.53	0.63%
AIK banka a.d. Niš	2557	62.53	159878	2557	52.86	135162.28	3.96%
ALFA PLAM a.d. Vranje	266	209.33	55681	266	179.57	47765.70	1.40%
Veterinarski zavod AD	3017	12.56	37892	3017	12.157	36678.01	1.08%
SUNCE FABRIKA ULJA A.D.	88	73.68	6484	88	63.985	5630.66	0.17%
RTC LUKA LEGET A.D.	223	55.39	12351	223	47.989	10701.46	0.31%
Novosadski sajam a.d. Novi Sad	1963	35.59	69854	1963	38.999	76555.41	2.24%
Gosha FOM	1810	23.03	41677	1810	15.48	28019.16	0.82%
Jedinstvo AD	42	131.90	5540	42	125.8	5283.70	0.15%
Univezal banka A.D	8	177.82	1423	8	144.56	1156.52	0.03%
Общо			390780			368330.43	10.62%
Акции Турция							
Koc Holding	27600	3.41	94241	27600	3.18	87854.05	2.58%
Haci Omer Sabanci Holding	16888	4.91	82911	16888	4.55	76897.66	2.25%

T. Garanti Bankasi	20000	5.26	105266	20000	4.43	88514.50	2.59%
Turkcell	15000	8.76	131362	15000	7.57	113621.98	3.33%
Akbank	15500	7.56	117230	15500	6.98	108174.94	3.17%
Общо			531011			475063.13	14.44%
Акции Македония							
Инново Статус Акции	51535	1.54	79110	51534.77	1.3733	70771.33	2.07%
Общо:			2911856			2680552	79.16%

Хеджиращи сделки

Не са сключвани хеджиращи сделки и няма отворена хеджираща позиция.

Дата на съставяне:

10.12.2009 г.

Съставили:

Иван Иванов:

Мария Сивкова: