

## **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 01.03.2010 г. до 31.03.2010 г.**

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

Към края на март 2010 г. нетната стойност на активите е 3 713 348.01 лева, което представлява увеличение от 178 908.85 лева спрямо края на февруари. За същият период дяловете в обръщение се увеличават с 1281.0085 и достигат до 4738031.2761. 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.

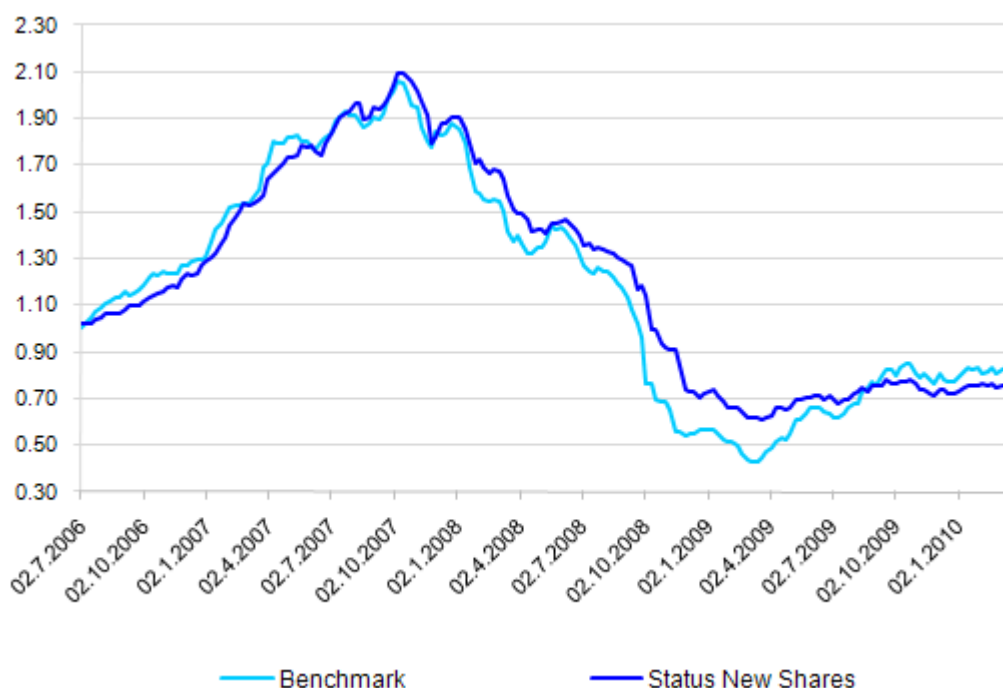
Изменение	Q1 2009	Q2 2009	Q3 2009	Q4 2009	Q1 2010	Март 2010
SOFIX	-22.4%	28.2%	34.6%	-11.01%	-2.0%	-1.18%
CROBEX	-15.4%	30.7%	15.9%	-8.80%	6.9%	0.2%
BELEX 15	-32.6%	49.5%	45.1%	-19.64%	3.2%	-2.96%
BET-C	-21.6%	35.7%	26.3%	2.14%	29.7%	14.9%
ISE 100	-4.1%	43.0%	30.0%	10.26%	7.0%	13.75%
<b>DFNEW</b>	<b>-19.2%</b>	<b>15.5%</b>	<b>8.3%</b>	<b>-4.89%</b>	<b>7.21%</b>	<b>5.03%</b>
<b>Средно аритметично за индексите</b>	<b>-17.65%</b>	<b>37.4%</b>	<b>30.4%</b>	<b>-5.41%</b>	<b>9.0%</b>	<b>4.94%</b>
<b>Дял на съответната държава от активите на фонда</b>	<b>31.03.2009</b>	<b>30.06.2009</b>	<b>30.09.2009</b>	<b>31.12.2009</b>	<b>28.02.2010</b>	<b>31.03.2010</b>
България	40.19%	32.26%	27.33%	27.40%	26.60%	24.70%
Хърватска	12.22%	11.36%	10.92%	5.72%	7.93%	8.55%
Сърбия и Македония	12.55%	12.29%	12.49%	11.27%	12.01%	11.52%
Румъния	9.07%	9.42%	10.32%	14.36%	17.10%	17.42%
Турция	11.13%	15.05%	14.87%	16.92%	15.60%	23.92%

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

Индекс	Стандартно отклонение	Изменение 12 месеца	Изменение 24 месеца
SOFIX	28.60%	50.5%	-66.6%
CROBEX	28.87%	47.6%	-44.3%
BELEX 15	38.17%	79.9%	-60.1%
BET-C	29.73%	127.0%	-29.1%
ISE 100	35.75%	119.4%	44.9%
Служебен бенчмарк	22.4%	84.9%	-31.0%
DFNEW	13.37%	27.45%	-47.69%

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. 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 последното тримесечие. С

допълнителното увеличаване на по-агресивни позиции смятаме, че корелацията с индекса ще достигне средните за последните години стойности.

Политическото напрежение в Турция от февруари намаля значително през март и турския пазар бе този, с най-висок принос за растежа на фонда. През месеца увеличихме дела на инвестициите в Турция до над 23% като добавихме още две индустриални компании и една банка. Излезлите изключително добри данни за турската индустрия – ръст на индустриалното производство за трети пореден месец и то с 24,84% на годишна база за декември 2009 /най-високият в региона/ и възстановяването на тренда на растеж на пазара им - бяха в основата на това решение. През месеца увеличихме и инвестициите в Хърватска и намалихме тези в България. След това реструктуриране делът на акциите в портфейла достигна 86,11% едно от най-високите нива за периода след началото на финансовата криза.

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



През месец март бяха направени следните сделки с ценни книжа:

#### Сделки с ценни книжа:

Покупки	Брой
AK ENERJI SHS	4600
IŞ BANKASI (C)	16800

Enka Insaat Ve Sanayi AS	11200
Atlanska Plovitba D.D. DUBROVNIK	130

Продажби	Брой
Aerostar S.A. Basau	57900
Златен лев холдинг АД	1280
София Комерс -заложни къщи АД	5860

### Обем и структура на инвестициите в портфейла

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

Активи	31.12.2009	31.01.2010	28.02.2010	31.03.2010	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	2 646 785	2 785 608	2 819 715	3 199 516	86.11%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	323 901	315 961	232 893	11 052	0.30%
Депозити до 3 мес.	499 511	500 002	500 494	502 562	13.53%
Вземания	1 380	3 391	5 186	2 463	0.07%
<b>Общо:</b>	<b>3 471 578</b>	<b>3 604 961</b>	<b>3 558 472</b>	<b>3 715 758</b>	<b>100.00%</b>

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

Дружество	28.02.2010			31.03.2010			
	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	5.862	31168	5317	5.8	30838.60	0.83%
Златен лев холдинг АД	28701	0.451	12944	24487	0.451	11043.64	0.30%
Софарма АД - София	3321	4.010	13317	3321	3.968	13177.73	0.35%

София Комерс - заложни къщи АД	37033	4.001	148169	31173	4.25	132485.25	3.57%
Унипак АД	21729	3.500	76052	21629	3.5	75701.50	2.04%
ЦКБ АД	14351	1.274	18283	14351	1.317	18900.27	0.51%
ПЪРВА ИНВЕСТИЦИОННА БАНКА АД	6000	2.411	14466	6000	2.385	14310.00	0.39%
Индустриален Холдинг България АД	10000	1.420	14200	10000	1.398	13980.00	0.38%
Монбат АД	3000	6.476	19428	3000	6.5	19500.00	0.52%
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	282929	0.590	166928	282929	0.55	155610.95	4.19%
ФОНД ЗА НЕДВИЖИМИ ИМОТИ БЪЛГАРИЯ АДСИЦ	10000	0.370	3700	10000	0.357	3570.00	0.10%
ДФ ДСК РАСТЕЖ	255038	0.764	194961	255038	0.7672	195675.36	5.27%
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.585	87371	149450	0.5846	87370.77	2.35%
MAUNTIN PARADAI INVEST ADSIC	150000	0.970	145518	150000	0.9701	145517.93	3.92%
<b>Общо:</b>			<b>946505</b>			<b>917681.98</b>	<b>24.70%</b>
<b>Акции Хърватска</b>							
Atlanska Plovitba D.D. DUBROVNIK	100	267.44	26744	230	262.26	60318.95	1.62%
Konchar Electroindustrija D.D.	545	125.81	68565	545	125.45	68368.53	1.84%
Konchar Transformatori	206	564.52	116292	206	592.5	122055.01	3.28%
Duro Dakovic holding	1000	10.60	10605	1000	9.4428	9442.84	0.25%
ULJANIK PLOVIDBA D.D.	174	166.67	29000	174	167.21	29094.30	0.78%
Institut IGH d.d	20	787.64	15753	20	689.3	13785.90	0.37%
INA	31	488.45	15142	31	476.58	14774.13	0.40%
<b>Общо:</b>			<b>282101</b>			<b>317839.66</b>	<b>8.55%</b>
<b>Акции Румъния</b>							
CNTEE TRANSELECTRICA SA	8275	8.176	67657	8275	9.5476	79006.56	2.13%

Oil Terminal Constanta	199400	0.133	26540	199400	0.1337	26653.14	0.72%
SNO - Santierul Naval Orsova	17700	2.852	50482	17700	2.9598	52387.79	1.41%
SIF MOLDOVA BACAU	234000	0.665	155725	234000	0.7208	168677.80	4.54%
SIF OLTENIA CRAIOVA	115000	0.756	86918	115000	0.8688	99915.84	2.69%
SIF Banat Crisana /SIF 1/	65000	0.675	43875	65000	0.7686	49957.92	1.34%
SIF Transilvania /SIF 3/	158800	0.397	63031	158800	0.4153	65953.05	1.77%
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	12400	7.035	87236	12400	7.4471	92344.58	2.49%
Aerostar S.A. Bacau	57900	0.333	19266				
Farmaceutica Remedia SA	104000	0.075	7811	104000	0.1193	12411.91	0.33%
<b>Общо</b>			<b>608541</b>			<b>647308.59</b>	<b>17.4%</b>
<b>Акции Сърбия</b>							
Agrobanka a.d. Beograd	120	179.54	21545	120	174.47	20936.08	0.56%
AIK banka a.d. Niš	2557	57.05	145865	2557	59.424	151946.11	4.09%
ALFA PLAM a.d. Vranje	266	170.78	45428	266	162.41	43201.08	1.16%
Veterinarski zavod AD	3017	12.98	39147	3017	12.822	38683.52	1.04%
RTC LUKA LEGET A.D.	223	51.94	11583	223	51.874	11567.88	0.31%
Novosadski sajam a.d. Novi Sad	1949	34.85	67921	1949	34.805	67834.43	1.83%
Gosha FOM	1807	13.74	24830	1807	13.724	24798.71	0.67%
Jedinstvo AD	42	121.51	5103	42	123.51	5187.56	0.14%
Univezal banka A.D	8	130.05	1040	8	130.38	1043.00	0.03%
<b>Общо</b>			<b>362462</b>			<b>365198.36</b>	<b>9.83%</b>
<b>Акции Турция</b>							
Koc Holding	27600	4.28	118154	27600	4.9582	136847.04	3.68%
AK ENERJI SHS				4600	16.591	76318.54	2.05%
Enka Insaat Ve Sanayi AS				11200	6.7699	75822.72	2.04%

Haci Omer Sabanci Holding	16888	5.44	91942	16888	6.4362	108693.85	2.93%
T. Garanti Bankasi	20000	5.30	106093	20000	6.7699	135397.71	3.64%
İŞ BANKASI (C)				16800	4.6722	78492.53	2.11%
Turkcell	15000	8.42	126334	15000	8.6769	130153.43	3.50%
Akbank	15500	7.26	112514	15500	9.4874	147054.31	3.96%
<b>Общо</b>			<b>555038</b>			<b>888780.13</b>	<b>23.92%</b>
<b>Акции Македония</b>							
Инново Статус Акции	51535	1.26	65068	51534.7717	1.2168	62707.26	1.69%
<b>Общо:</b>			<b>2819715</b>			<b>3199515.98</b>	<b>86.1%</b>

### Хеджиращи сделки

Не са сключвани хеджиращи сделки и няма отворена хеджираща позиция.

**Дата на съставяне:**

09.04.2010 г.

**Съставили:**

Иван Иванов:

Мария Сивкова: