

ИНФОРМАЦИЯ

СЪГЛАСНО ИЗИСКВАНИЯТА НА ЧЛ. 72, АЛ. 2 ОТ НАРЕДБА № 44,

**ИЗГОТВЕНА ОТ УД „СТАТУС КАПИТАЛ” АД
ОТНОСНО ПОРТФЕЙЛА
НА ДОГОВОРЕН ФОНД „СТАТУС НОВИ АКЦИИ”**

ЗА ПЕРИОДА от 01.12.2011 г. до 31.12.2011 г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на декември 2011 г. нетната стойност на активите на фонда е 3522835.24 лева, което представлява намаление от -205270.83 лева спрямо края на ноември. За същия период дяловете в обращение намаляват с -327355.36 и достигат до 5963677.87 бр. 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 2010	Q4 2010	Q 1 2011	Q2 2011	Q3 2011	Q4 2011	Декември 2011
SOFIX	3.8%	-8.41%	22.93%	-7.11%	-16.13%	-7.18%	4.29%
CROBEX	3.3%	-2.41%	8.50%	-2.60%	-16.87%	-6.16%	0.06%
BELEX 15	-2.2%	2.38%	16.43%	-1.44%	-26.11%	-9.71%	1.53%
BET-C	10.6%	-0.14%	13.28%	-6.02%	-20.05%	-1.01%	1.38%
ISE 100	19.9%	4.54%	-2.38%	-1.81%	-5.65%	-14.12%	-5.96%
DFNEW	6.71%	1.94%	2.02%	-5.3%	-13.90%	-6.36%	-0.32%
Средно аритметично за индексите	7.1%	-0.81%	11.75%	-3.79%	-16.96%	-7.63%	0.26%
Дял на съответната държава от активите на фонда	30.09.2010	31.12.2010	31.03.2011	30.06.2011	30.09.2011	31.12.2011	
България	20.77%	19.96%	22.06%	22.76%	22.45%	16.05%	
Хърватска	8.25%	8.63%	10.25%	11.35%	10.92%	9.27%	
Сърбия и Македония	9.92%	9.09%	10.17%	8.65%	7.22%	5.61%	
Румъния	13.63%	11.17%	15.89%	13.32%	14.36%	17.78%	
Турция	30.26%	27.45%	21.36%	21.14%	23.20%	21.93%	

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

Индекс	Стандартно отклонение	Изменение 12 месеца	Изменение 24 месеца
SOFIX	16.66%	-11.11%	-24.61%
CROBEX	15.82%	-17.56%	-13.17%
BELEX 15	19.61%	-23.43%	-24.82%
BET-C	18.66%	-15.74%	-7.04%
ISE 100	24.87%	-22.33%	-2.95%
Служебен бенчмарк	14.5%	-18.03%	-14.52%
DFNEW	14.06%	-22.06%	-19.19%

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

Движение на цената на фонда спрямо служебния бенчмарк



През декември се достигна до известно успокоение на финансовите пазари. След значителното нарастване на възприетия риск през последните месеци, намесата на ЕЦБ за осигуряване на на практика неограничена ликвидност на банките от еврозоната донякъде успокои ситуацията. Очакванията са, че значителна част от тези почти 490 милиарда евро банките ще закупват държавни ценни книжа на държавите от еврозоната. По този начин ЕЦБ избягва прякото си действие като кредитор от последна инстанция на правителства, решение което използваша САЩ и Великобритания, но е кредитор от последна инстанция на банките. И в крайна сметка тези пари ще достигнат и до правителствата по един или друг начин. Въпреки тези очаквания, до момента, в който дълговите пазари на Италия и Испания не се върнат в нормалните си траектории, не би могло да се говори за решение на кризата в Европа. Действията на ЕЦБ, заедно със заявената решимост на европейските лидери да реформират механизмите за бюджетен контрол в Еврозоната, дават основателни причини да смятаме, че най-острата част от кризата в Еврозоната е преминала. До колко и кога това ще се отрази силно и на пазарите на акции е трудно да се

определи, но през декември повечето европейски индекси вече се търгуват над достигнатите преди това дъна.

И през декември запазахме относително по-консервативния подход от последните месеци. Делът на акциите остана минимално над 70%. Единствено инвестициите ни в Турция и Румъния ги поддържаме над теоретичната средна от 17%, инвестирани в един пазар. Смятаме че при обръщане на тенденцията и преминаване към бичи пазар така ще успеем да запазим възможностите за растеж, като в същото време поддържането на относително високо ниво на парични средства ограничава негативните последствия при развитие на негативни сценарии.

Доходност по месеци	Средно аритметично за индексите	DFNEW
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%
Юни 2011	-2.87%	-1.70%
Юли 2011	-2.18%	-2.98%
Август.11	-9.94%	-7.65%
Септември.11	-5.66%	-3.90%
Октомври.11	-0.78%	-1.60%
Ноември.11	-7.09%	-4.53%
Декември .11	0.26%	-0.32%

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	30.9.2011	31.10.2011	30.11.2011	31.12.2011	Структура на активите спрямо общата им стойност !%/
Акции и права	2 509 765	2 471 312	2 573 802	2 496 058	70.64%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	80 211	1 042 108	548 550	167 984	4.75%
Депозити до 3 мес.	609 134	609 761	610 264	867 795	24.56%
Вземания	11 753	3 913	6 089	1 804	0.05%
Разходи за бъдещи периоди	552	366	186	0	0.00%
Общо:	3 211 415	4 127 460	3 738 891	3 533 642	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “Статус Нови Акции” акции

	30.11.2011			31.12.2011			
Дружество	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	5.99	31844	5317	5.81	30908	0.87%
Софарма АД - София	3321	3.19	10594	3321	3.18	10544	0.30%
София Комерс - заложни къщи АД	9097	5.48	49852	9097	5.65	51398	1.45%
Индустриален Холдинг България АД	23333	0.59	13743	23333	0.61	14163	0.40%
М+С ХИДРАВЛИК АД	3830	6.697	25650	3830	6.984	26749	0.76%
ТРЕЙС ГРУП ХОЛД АД	4972	3.26	16204	4972	3.26	16209	0.46%
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	282929	0.66	186733	282929	0.59	166928	4.72%
ДФ ДСК РАСТЕЖ	255038	0.66	167279	255038	0.66	168366	4.76%
ДФ ОБЩИНСКА БАНКА - ПЕРСПЕКТИВА	4274	12.212	52200				
ДФ ОБЩИНСКА БАНКА - БАЛАНСИРАН	1690	12.46	21067				
АДВАНС ТЕРАФОНД АДСИЦ - СОФИЯ	3300	1.27	4204	3300	1.430	4719	0.13%
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.60	89670	149450	0.52	77254	2.19%
Общо:			669039			567238	16.05%
Акции Хърватска							
Adris P-A	560	53.96	30219	560	56.83	31823	0.90%
Atlanska Plovitba D.D. DUBROVNIK	230	87.86	20207	230	85.89	19756	0.56%
Duro Dakovic holding	1000	11.90	11900	1000	13.16	13156	0.37%
DALEKOVOD D.D.	550	33.89	18639	550	33.48	18411	0.52%
Institut IGH d.d	20	207.12	4142	20	194.62	3892	0.11%
Konchar Transformatori	412	271.12	111700	412	268.58	110655	3.13%

Konchar Electroindustrija D.D.	844	125.17	105644	844	133.38	112574	3.19%
ULJANIK PLOVIDBA D.D.	183	97.09	17768	183	93.68	17143	0.49%
Общо:			320220			327411	9.27%
Акции Румъния							
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	12400	4.58	56822	12400	4.85	60080	1.70%
CNTEE TRANSELECTRICA SA	8275	7.44	61563	8275	7.87	65138	1.84%
SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/	880000	0.19	167231	880000	0.19	169991	4.81%
SIF Banat Crisana /SIF 1/	65000	0.39	25405	65000	0.41	26553	0.75%
SIF MOLDOVA BACAU	234000	0.41	95034	234000	0.49	114329	3.24%
SIF OLTENIA CRAIOVA	335000	0.46	153510	335000	0.48	160190	4.53%
Farmaceutica Remedia SA	104000	0.09	9765	104000	0.09	9363	0.26%
SNO - Santierul Naval Orsova	17700	1.21	21470	17700	1.28	22581	0.64%
Общо			590800			628224	17.78%
Акции Сърбия							
Agrobanka a.d. Beograd	132	64.95	8574	132	56.05	7399	0.21%
AIK banka a.d. Niš	2673	28.23	75472	2673	30.80	82335	2.33%
ALFA PLAM a.d. Vranje	266	135.44	36026	266	134.57	35797	1.01%
Jedinstvo AD	42	95.26	4001	42	90.74	3811	0.11%
RTC LUKA LEGET A.D.	223	54.63	12183	223	40.09	8940	0.25%
Novosadski sajam a.d. Novi Sad	1951	27.84	54316	1951	21.49	41936	1.19%
Veterinarski zavod AD	3017	6.21	18728	3017	6.00	18101	0.51%
Общо			209300			198320	5.61%
Акции Турция							

Akbank	20666	4.89	101122	20666	4.82	99592	2.82%
AK ENERJI SHS	26457	1.61	42662	26457	1.47	38970	1.10%
Enka Insaat Ve Sanayi AS	15554	3.46	53869	15554	3.28	51050	1.44%
T. Garanti Bankasi	20000	4.73	94686	20000	4.72	94461	2.67%
İŞ BANKASI (C)	16800	2.85	47908	16800	2.65	44515	1.26%
Koc Holding	33100	4.61	152498	33100	4.55	150504	4.26%
Haci Omer Sabanci Holding	16888	4.40	74318	16888	4.32	73004	2.07%
TAV HAVALIMANLARI	18000	6.13	110382	18000	6.45	116139	3.29%
Turkcell	15000	7.13	106998	15000	7.11	106629	3.02%
Общо			784442			774866	21.93%
Общо:			2573802			2496058	70.64%

Хеджиращи сделки

Фонда не притежава деривативни инструменти и не са сключвани сделки с такива.

Не са сключвани хеджиращи сделки и няма отворена хеджираща позиция.

Дата на съставяне:

10.1.2012 г.

Съставил:

Иван Иванов: