

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 01.5.2012 г. до 31.5.2012 г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на май 2012 г. нетната стойност на активите на фонда е 4 311 961.19 лева, което представлява намаление от -10 105.97 лева спрямо края на април. За същия период дяловете в обращение се увеличават с 351 315.5054 и достигат до 7 222 988.3701 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.

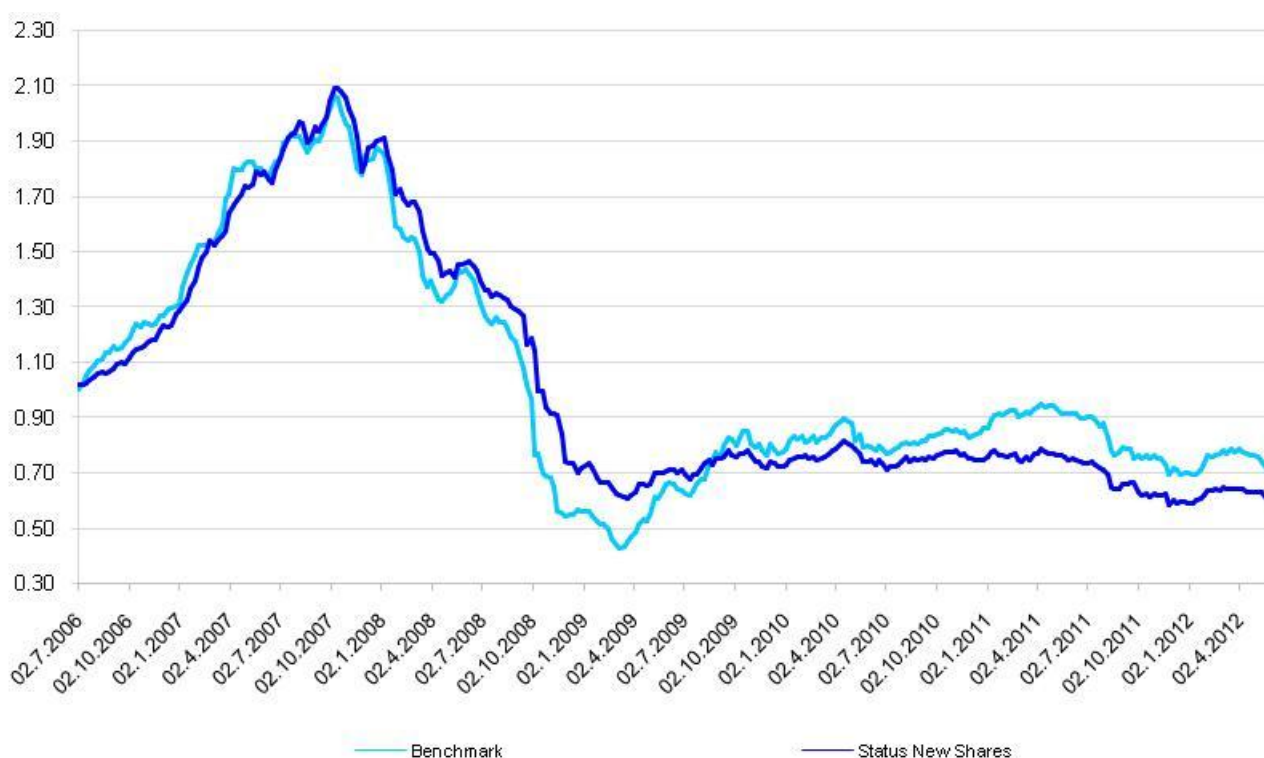
Изменение	Q4 2010	Q 1 2011	Q2 2011	Q3 2011	Q4 2011	Q1 2012	Май 2012
SOFIX	-8.41%	22.93%	-7.11%	-16.13%	-7.18%	-4.10%	-2.58%
CROBEX	-2.41%	8.50%	-2.60%	-16.87%	-6.16%	5.36%	-7.35%
BELEX 15	2.38%	16.43%	-1.44%	-26.11%	-9.71%	6.59%	-8.70%
BET-C	-0.14%	13.28%	-6.02%	-20.05%	-1.01%	17.34%	-13.47%
ISE 100	4.54%	-2.38%	-1.81%	-5.65%	-14.12%	21.76%	-8.18%
DFNEW	1.94%	2.02%	-5.3%	-13.90%	-6.36%	8.89%	-5.09%
Средно аритметично за индексите	-0.81%	11.75%	-3.79%	-16.96%	-7.63%	9.39%	-8.06%
Дял на съответната държава от активите на фонда	31.12.2010	31.03.2011	30.06.2011	30.09.2011	31.12.2011	31.03.2012	31.05.2012
България	19.96%	22.06%	22.76%	22.45%	16.05%	17.33%	18.97%
Хърватска	8.63%	10.25%	11.35%	10.92%	9.27%	8.03%	7.29%
Сърбия и Македония	9.09%	10.17%	8.65%	7.22%	5.61%	4.43%	3.82%
Румъния	11.17%	15.89%	13.32%	14.36%	17.78%	19.88%	19.24%
Турция	27.45%	21.36%	21.14%	23.20%	21.93%	23.03%	20.70%

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

Индекс	Стандартно отклонение	Изменение 12 месеца	Изменение 24 месеца
SOFIX	13.68%	-31.82%	-22.98%
CROBEX	15.89%	-26.79%	-16.01%
BELEX 15	19.60%	-45.68%	-32.51%
BET-C	21.05%	-21.14%	-12.22%
ISE 100	25.27%	-12.60%	1.31%
Служебен бенчмарк	15.7%	-27.61%	-16.48%
DFNEW	13.78%	-19.90%	-19.55%

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

Движение на цената на фонда спрямо служебния бенчмарк



През месец май рисковете пред европейската икономика продължиха да оказват натиск върху пазарите. Европейската икономика все по-ясно навлиза във втора рецесия, плод на дълговата криза от есента на миналата година. Макар че очакванията са тази рецесия да продължи само две тримесечия, и растежът в Европа да се върне през второто тримесечие на 2012, самият факт на спадащ БВП, създава несигурност в Европа. Големите развиващи се пазари като Китай и Индия също показват признаци за охлаждане, като така и последния двигател на икономическия растеж в световен план намалява влиянието си. Нуждата от спасяване на Банкия, третата по-големина банка в Испания, в съчетание с неясната политическа ситуация в Гърция и несигурността как ще се отрази евентуално излизане на страна от Еврозоната повишиха рисковите премии в Европа. Ситуацията напомни за кризисните моменти от декември миналата година преди ЕЦБ да налее ликвидност във финансовата система. Банките в Еврозоната макар и да повишиха значително ликвидността си, все още остава да се сблъскат с доста предизвикателства през оставащите месеци. Една значителна част от тях трябва да си увеличат капитала, за да отговорят на новите изисквания за капиталова адекватност. Като това се отнася с

особена тежест за Испания, където пазарите имат сериозни съмнения че банките не са провизирали достатъчно лоши кредити, раздадени покрай строителния бум.

Проблемите, които трябва да реши Европа през следващите месеци, са капитализация на испанските банки и как точно смята да стимулира растежа в зоната, защото вече е очевидно, че едностранчивото поставяне на бюджетната дисциплина и намаляване на дълговете на първо място дава доста противоречиви резултати. Голямата въпросителна е и бъдещето на Гърция в еврозоната и евентуално пренасяне на паника и сред други членки, ако Гърция излезе.

Балканските пазари, на които инвестира ДФ Статус Нови Акции, поради близостта и значителните икономически връзки с Гърция, се оказаха едни от най-засегнати от политическата несигурност в южната ни съседка.

Доходност по месеци	Средно аритметично за индексите	DFNEW
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%
Януари 2012	4.38%	5.52%
Февруари 2012	4.70%	2.58%
Март 2012	-0.01%	0.59%
Април 2012	-3.66%	-2.21%
Май 2012	-8.06%	-5.09%

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	31.1.2012	29.2.2012	31.3.2012	31.5.2012	Структура на активите спрямо общата им стойност /%I
Акции и права	3 306 895	3 333 676	3 483 630	3 164 168	73.14%
Облигации	-	-	-	-	
Парични средства	20 560	116 124	92 714	307 132	7.10%
Депозити до 3 мес.	818 354	730 397	731 347	732 165	16.92%
Вземания	6 516	202 751	25 799	121 895	2.82%
Разходи за бъдещи периоди	251	1 406	1 228	1 044	0.02%
Общо:	4 152 576	4 384 354	4 334 717	4 326 403	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ "Статус Нови Акции" акции

	30.4.2012			31.5.2012			
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	5.29	28132	5317	5.22	27733	0.64%
София Комерс - заложни къщи АД	9097	6.00	54564	9097	5.75	52308	1.21%
Индустриален Холдинг България АД	23333	0.64	14933	23333	0.61	14233	0.33%
М и С ХИДРАВЛИК АД	3830	6.95	26619	3830	6.59	25232	0.58%
ТРЕЙС ГРУП ХОЛД АД	6272	3.061	19199	6272	2.919	18308	0.42%
ПРАЙМ ПРОПЪРТИ БГ АДСИЦ	282929	0.56	157026	282929	0.56	158440	3.66%
АДВАНС ТЕРАФОНД АДСИЦ - СОФИЯ	47300	1.73	81829	47300	1.60	75680	1.75%
ЕЛАРГ ФОНД ЗА ЗЕМЕДЕЛСКА ЗЕМЯ АДСИЦ	23168	1.25	28844	23168	1.84	42629	0.99%
ФЕЪРГПЛЕЙ ПРОПЪРТИ АДСИЦ	93100	0.296	27558	93100	0.280	26068	0.60%
ФОНД ЗА НЕДВИЖИМИ ИМОТИ БЪЛГАРИЯ АДСИЦ	40100	0.74	29514	40100	0.73	29113	0.67%
ГЛОБЕКС ИСТЕЙТ ФОНД АДСИЦ	149450	0.52	77254	149450	0.52	77254	1.79%
ДФ ДСК РАСТЕЖ	365468	0.64	232540	365468	0.61	224138	5.18%
ОББ ПЛАТИНУМ ЕВРО ОБЛИГАЦИИ	251	196.79	49441	251	197.04	49503	1.14%
Общо:			827451			820640	18.97%
Акции Хърватска							
Adris P-A	560	56.71	31756	560	54.88	30732	0.71%
Atlanska Plovitba D.D. DUBROVNIK	230	83.28	19154	230	71.19	16374	0.38%
Duro Dakovic holding	1000	22.12	22118	1000	17.86	17861	0.41%
DALEKOVOD D.D.	550	32.87	18076	550	30.03	16515	0.38%

Institut IGH d.d	20	191.80	3836	20	190.28	3806	0.09%
Konchar Transformatori	412	268.05	110437	412	264.04	108784	2.51%
Konchar Electroindustrija D.D.	844	132.10	111488	844	128.14	108154	2.50%
ULJANIK PLOVIDBA D.D.	183	84.56	15474	183	71.69	13119	0.30%
Общо:			332339			315346	7.29%
Акции Румъния							
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	12400	4.66	57759	12400	4.07	50486	1.17%
CNTEE TRANSELECTRICA SA	29275	6.73	196911	29275	5.38	157641	3.64%
SC FONDUL PROPRIETATEA SA - BUCURESTI /FP/	1180000	0.25	293758	1180000	0.21	251581	5.82%
SIF Banat Crisana /SIF 1/	125000	0.48	59674	125000	0.37	46515	1.08%
SIF MOLDOVA BACAU	234000	0.51	118281	234000	0.45	105721	2.44%
SIF OLTENIA CRAIOVA	335000	0.63	209800	335000	0.46	152526	3.53%
SIF Transilvania	200000	0.33	66817	200000	0.20	39314	0.91%
Farmaceutica Remedia SA	104000	0.11	11636	104000	0.11	11428	0.26%
SNO - Santierul Naval Orsova	17700	1.01	17831	17700	0.96	17048	0.39%
Общо			1032466			832260	19.24%
Акции Сърбия							
Agrobanka a.d. Beograd	132	16.60	2192	132	0.00	0	0.00%
AIK banka a.d. Niš	2673	27.97	74753	2673	23.51	62854	1.45%
ALFA PLAM a.d. Vranje	266	122.35	32545	266	114.87	30556	0.71%
Jedinstvo AD	42	83.81	3520	42	73.70	3095	0.07%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	210	28.14	5910	210	27.00	5671	0.13%
RTC LUKA LEGET A.D.	223	51.65	11519	223	49.57	11053	0.26%

Novosadski sajam a.d. Novi Sad	1951	19.21	37473	1951	18.43	35958	0.83%
Veterinarski zavod AD	3017	5.21	15714	3017	5.38	16243	0.38%
Общо			183626			165431	3.82%
Акции Турция							
AKBANK	20666	5.48	113201	20666	4.62	95539	2.21%
AK ENERJI SHS	26457	1.79	47344	26457	1.60	42425	0.98%
Enka Insaat Ve Sanayi AS	15554	4.62	71871	17420	3.39	58988	1.36%
T. GARANTI BANKASI	34500	5.43	187240	34500	5.07	174796	4.04%
İŞ BANKASI (C)	16800	3.38	56739	16800	3.27	54883	1.27%
KOC HOLDING	33100	5.48	181311	33100	5.17	171091	3.95%
Haci Omer Sabanci Holding	16888	6.13	103574	16888	6.02	101697	2.35%
TAV HAVALIMANLARI	18000	7.76	139731	18000	7.68	138179	3.19%
TURK TRAKTOR	2500	25.88	64690	2500	23.20	58001	1.34%
Turkcell	15000	7.38	110646	15000	7.01	105170	2.43%
YAPI VE KREDI BANKASI	11500	2.73	31400	11500	2.58	29721	0.69%
Общо			965702			895601	20.70%
Общо:			3483630			3164168	73.14%

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:

Съставил:

08.6.2012 г.

Иван Иванов: