

ИНФОРМАЦИЯ

СЪГЛАСНО ИЗИСКВАНИЯТА НА ЧЛ. 48, АЛ. 3 ОТ НАРЕДБА № 25,

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

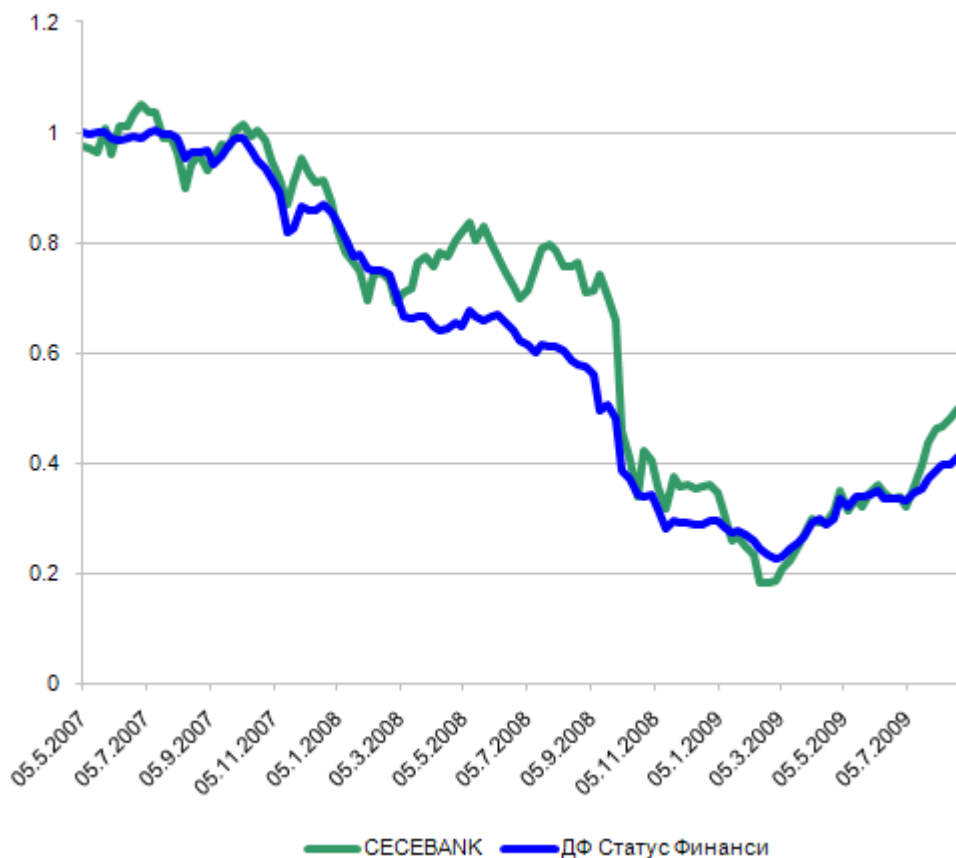
ЗА ПЕРИОДА ОТ 01.08.2009 Г. ДО 31.08.2009 Г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на месец август нетните активи на Статус Финанси са 1 128 683.48 лв., което представлява увеличение с 239 485.06 лв. спрямо края на месец юли. Броят на емитираните дялове се увеличава със 348 594.27 и достига 2 747 860.4054 бр.

И през август продължи тренда на възстановяване на пазарите. Повечето основни индекси преминаха над стойностите си от началото на 2009 и в момента се търгуват на равнищата от октомври 2008. Достигането на подобни нива потвърждават предположението от март че най-тежката част от кризата вече е зад гърба на инвеститорите. Финансовият сектор, като един от най-засегнати то кризата реализира и значителни растежи в процеса на компенсация на предходните негативни тенденции. Отчетите за второто тримесечие на повечето банки потвърждават, че макар да се намират все още далеч от равнищата си през 2007, то и ефекта на кризата е далеч по-слабо разрушителен от първоначалните очаквания. С появяването на все повече информация, вече е възможно да се дефинират конкретните ефекти върху отделните банки и страни, което пък довежда до бързо прекалкулиране на специфичния риск приписван на всяка една институция.

През месеца предприехме леко намаление на делът на турските акции в портфейла. Този пазар до голяма степен вече е компенсирал значителния спад под влияние на кризата, което прави потенциала за средносрочен растеж по-нисък от този на останалите ни пазари, на които инвестираме. Поради тази причина и увеличихме дела на българските акции, макар и да го подържаме все още на под 10% от активите. Продължаваме да подържаме относително високо ниво на ликвидни средства, които ни дават възможност за бърза реакция при възникване на подходящи възможности за изгодна инвестиция.



Горната графика представя движението на индекса CECE BNK представящ движението на банковите акции на банки от Източна Европа, съчетан с движението на Статус Финанси. Основните различия между CECE BANK и портфейла на ДФ Статус финанси е значителното присъствие на полски банки в индекса и отсъствието им в договорния фонд. Другото основно различие е значителната част от портфейла на Статус Финанси в кеш и депозити, което изглажда колебанията на индекса. Най-ясно това се забелязва от значително по-ниското стандартно отклонение на ДФ Статус Финанси спрямо съответното на индекса.

Изменение	Q1 2008	Q2 2008	Q3 2008	Q4 2008	Q1 2009	Q2 2009	Юли 2009	Август 2009
ДФ Статус Финанси	-23.6%	-3.8%	-24.3%	-38.87%	-19.14%	39.00%	8.87%	10.82%
CECE Banking Financial Index	-18.05%	-3.82%	-9.6%	-44.63%	-37.97%	51.66%	27.92%	13.97%

Стандартно отклонение

	Стандартно отклонение
ДФ Статус Финанси	40.64%
CECE Banking Financial Index	71.22%

Покупки и продажби на ценни книжа

Покупки	Брой
ПЪРВА ИНВЕСТИЦИОННА БАНКА АД	12608
ЦКБ АД	20000

Продажби	Брой
T. Garanti Bankasi	2700

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

Активи	30.06.2009	31.07.2009	31.08.2009	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	545 096	612 475	778 161	68.91%
Облигации	-	-	-	-
Парични средства	132 484	145 595	223 630	19.80%
Депозити до 3 мес.	121 510	123 065	123 187	10.91%
Вземания	6 521	8 536	4 230	0.37%
Общо:	805 611	889 671	1 129 208	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ "Статус Финанси" акции

Дружество	30.06.2009			31.07.2009			31.08.2009			
	Брой ценни книжа	Цена за брой	Балансова стойност	Брой ценни книжа	Цена за брой	Балансова стойност	Брой ценни книжа	Цена за брой	Балансова стойност	Процент от активите
Raiffeisen International Bank-Hold. AG	851	50.05	42592	851	67.902	52678.62	851	74.67	63547	5.63%
КВС	400	26.39	10558	400	28.555	11422.05	400	53.79	21514	1.91%
София Комерс-заложни къщи АД	5700	4.70	26790	5700	4.00	22800.00	5700	3.85	21945	1.94%

ЦКБ АД	-	-	-	-	-	-	20000	1.58	31520	2.79%
ПЪРВА ИНВЕСТИЦИО ННА БАНКА АД	-	-	-	-	-	-	12608	2.99	37635	3.33%
Akbank Turk AS	5000	6.38	31897	5000	7.778	38891.68	5000	7.97	39836	3.53%
T. Garanti Bankasi	18700	3.78	70732	18700	4.836	90427.38	16000	5.24	83769	7.42%
Turkiye Halk Bankasia A.S.	4100	5.70	23373	4100	7.263	29777.91	4100	7.47	30612	2.71%
Asya Katilim Bankasi A.S.	12000	1.91	22912	12000	2.568	30813.46	12000	2.59	31031	2.75%
NBG	1040	37.94	39461	1040	38.784	40335.47	1271	45.61	57970	5.13%
Piraeus Bank S.A.	1021	13.16	13439	1021	16.331	16674.14	1021	21.83	22285	1.97%
Croatia Osiguranje D.D.	25	922.65	23066	25	970.426	24260.66	25	1062.37	26559	2.35%
Jadransko Osiguranje D.D.	59	699.18	41252	59	585.235	34528.88	59	756.81	44652	3.95%
OTP	1100	26.25	28878	1100	28.252	31076.94	1100	35.04	38541	3.41%
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	5400	3.79	20459	5400	4.822	26037.57	5400	5.93	32006	2.83%
SIF Moldova Bacau	88000	0.33	28636	88000	0.371	32639.69	88000	0.47	41156	3.64%
SIF Oltenia Craiova	79000	0.40	31216	79000	0.436	34429.31	79000	0.55	43166	3.82%
Agrobanka a.d. Beograd	110	125.59	13815	110	133.245	14656.99	110	197.51	21726	1.92%
AIK banka a.d. Niš	1036	43.77	45342	1036	44.093	45680.69	1036	51.90	53773	4.76%
Metals Banka AD Novi Sad	105	116.54	12237	105	117.526	12340.26	105	130.29	13680	1.21%
Univezal banka A.D	17	131.70	2239	17	132.217	2247.69	17	164.96	2804	0.25%
Dunav Osiguranje A.D.	258	62.79	16201	258	67.913	17521.65	258	71.45	18433	1.63%
NBG - права	-	-	-	1040	3.11	3234.16	-	-	-	
Общо:			545096			612475.2			778161	68.91%

Хеджиращи сделки

Не са сключвани хеджиращи сделки и няма отворена хеджираща позиция.

Дата на съставяне:
04.09.2009 г.

Съставили:

Иван Иванов:

Мария Сивкова: