

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 01.06.2009 Г. ДО 30.06.2009 Г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на месец юни нетните активи на Статус Финанси са 805 161.79 лв., което представлява увеличение със 17 642.30 лв. спрямо края на месец май. Броят на емитираните дялове се увеличава със 44 170.94 бр. и достига 2 365 380.4254 бр.

След изключително доброто представяне на финансовите акции през март, април и май, през юни вече се забелязва известно спадане на темповете на растеж. До голяма степен растежът от второто тримесечие на финансовите компании се дължеше на изключително песимистичните настроения към сектора от първото тримесечие. След като голяма част от опасенията, свързани с възможни лоши сценарии за развитие на финансовата инфраструктура в глобален мащаб, намаляха, то това редуциране на възприемания риск се отрази на котировките и на банковите акции. Увеличената ликвидност на банковите системи, както поради намеси на правителства и централни банки, така и поради свиването на рисковите експозиции, постепенно връща доверието на инвеститорите в сектора. В същото време ревизирането на предходните оценки, основани на предположенията за по-висока вероятност за реализиране на негативни сценарии, и използването на по-реалистични към новите данни оценки за риска на отделните финансови институции, доведе до растеж през тримесечието. Към момента секторът се търгува на нивата след фалита на Лемън Брадърс, изключение правят турските банки които през последните четири месеца успяха да компенсират цялото си негативно движение след фалита и в момента са на равнищата си от първата половина на 2008 г. Което направи значителното увеличение на дела на тези банки в портфейла на Статус Финанси успешен ход за подобряване на съотношенията риск доходност.



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.

Изменение	Q4 2007	Q1 2008	Q2 2008	Q3 2008	Q4 2008	Q1 2009	Q2 2009	Юни 2009
ДФ Статус Финанси	-11.1%	-23.6%	-3.8%	-24.3%	-38.87%	-19.14%	39.00%	0.03%
CECE Banking Financial Index	-5.85%	-18.05%	-3.82%	-9.6%	-44.63%	-37.97%	51.66%	6.15%

Стандартно отклонение

	Стандартно отклонение
ДФ Статус Финанси	39.38%
CECE Banking Financial Index	68.43%

Покупки и продажби на ценни книжа

През месец юни са извършвани следните продажби.

Позиция	Брой
T. Garanti Bankasi	4300
КВС	500

Обем и структура на инвестициите в портфейла

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

Активи	30.04.2009	31.05.2009	30.06.2009	Структура на активите спрямо общата им стойност [%]
Акции и права	484 612	571 225	545 096	67.66%
Облигации	-	-	-	-
Парични средства	18 784	126 721	132 484	16.45%
Депозити до 3 мес.	179 727	101 438	121 510	15.08%
Вземания	95	5 679	6 521	0.81%
Общо:	683 219	805 062	805 611	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “Статус Финанси” акции

Дружество	30.04.2009		31.05.2009			30.06.2009		Балансо ва стойност	Процент от активите	
	Цена за брой	Брой ценни книжа	Цена за брой	Цена за брой	Брой ценни книжа	Цена за брой	Брой ценни книжа			
Raiffeisen International Bank-Hold. AG	851	47.92	40778	851	58.11	49450	851	50.05	42592	5.29%
KBC	900	31.66	28498	900	28.36	25524	400	26.39	10558	1.31%
София Комерс-зложни къщи АД	5700	3.98	22669	5700	4.00	22800	5700	4.70	26790	3.33%
Akbank Turk AS	5000	5.36	26824	5000	5.80	29018	5000	6.38	31897	3.96%
T. Garanti Bankasi	23000	3.00	68928	23000	3.46	79468	18700	3.78	70732	8.78%
Turkiye Halk Bankasia A.S.	4100	4.95	20289	4100	5.31	21765	4100	5.70	23373	2.90%
Asya Katilim Bankasi A.S.	12000	1.38	16538	12000	1.64	19651	12000	1.91	22912	2.84%
NBG	1040	29.30	30470	1040	37.63	39135	1040	37.94	39461	4.90%
Piraeus Bank S.A.	1000	12.71	12713	1000	15.80	15803	1021	13.16	13439	1.67%
Croatia Osiguranje D.D.	25	871.00	21775	25	1117.62	27940	25	922.65	23066	2.86%
Jadransko Osiguranje D.D.	59	646.66	38153	59	798.30	47100	59	699.18	41252	5.12%

OTP	1100	18.64	20502	1100	24.45	26893	1100	26.25	28878	3.58%
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	5400	3.13	16892	5400	3.60	19444	5400	3.79	20459	2.54%
SIF Moldova Bacau	88000	0.34	30197	88000	0.31	27159	88000	0.33	28636	3.55%
SIF Oltenia Craiova	79000	0.40	31535	79000	0.40	31586	79000	0.40	31216	3.87%
Agrobanka a.d. Beograd	110	68.01	7482	110	107.67	11843	110	125.59	13815	1.71%
AIK banka a.d. Niš	1036	33.86	35083	1036	48.01	49739	1036	43.77	45342	5.63%
Metals Banka AD Novi Sad	105	65.59	6887	105	99.39	10436	105	116.54	12237	1.52%
Univezal banka A.D	4	112.97	452	17	131.60	2237	17	131.70	2239	0.28%
Dunav Osiguranje A.D.	258	30.80	7947	258	55.18	14235	258	62.79	16201	2.01%
Общо:			484612			571225			545096	67.66%

Хеджиращи сделки

Не са сключвани хеджиращи сделки и няма отворена хеджираща позиция.

Дата на съставяне:
10.07.2009 г.

Съставили:

Иван Иванов:

Мария Сивкова: