

ИНФОРМАЦИЯ

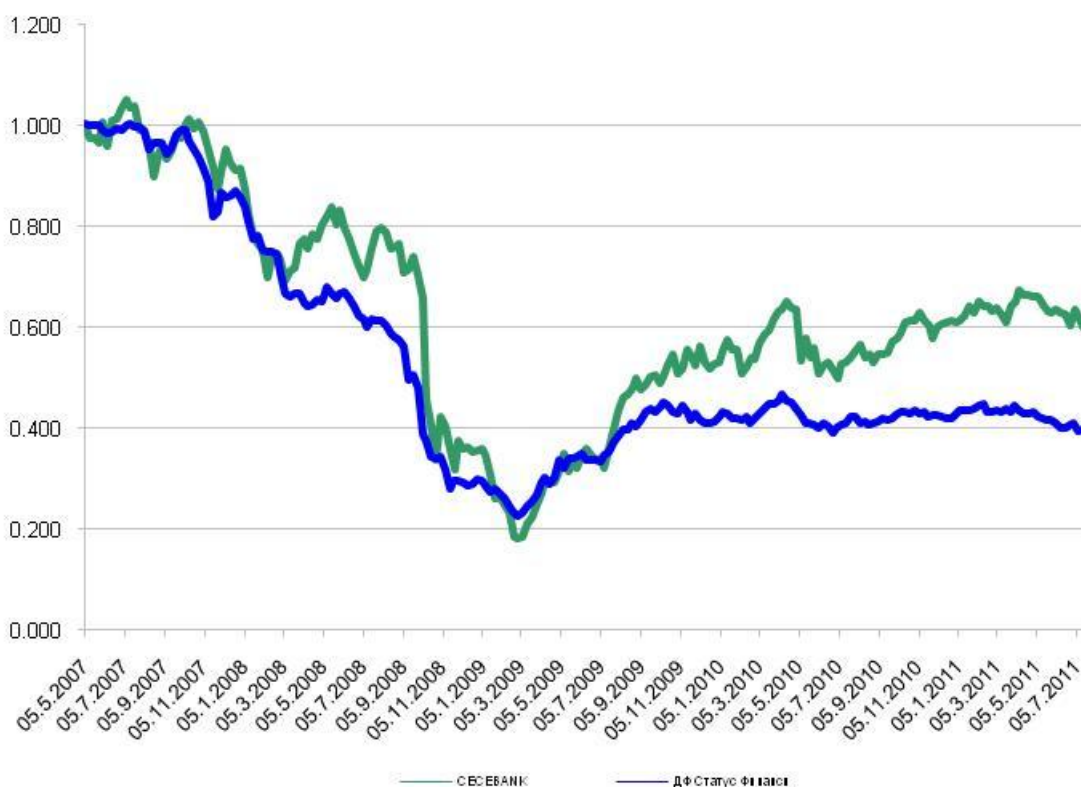
СЪГЛАСНО ИЗИСКВАНИЯТА НА ЧЛ. 48, АЛ. 3 ОТ НАРЕДБА № 25,

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

ЗА ПЕРИОДА от 01.7.2011 г. до 31.7.2011 г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на месец юли нетните активи на Статус Финанси са 938 803.23 лв., което представлява намаление с 42 809.43 лв. спрямо края на месец юни. Броят на емитираните дялове намалява с 10 396.46 и достига 2 436 568.33 бр.



Горната графика представя движението на индекса CECE BNK представящ движението на акции на банки от Източна Европа, съчетан с движението на Статус Финанси.

През юли ЕС достигна до относително по-трайно решение на гръцката криза, а и по-приемливо за пазарите. Облекчението от намаляването на тежестта на този проблем бе засенчено от нарасналото напрежение около испанския и особено италианския дълг. С повишаващи се лихви по държавните й облигации Италия е значително по-голям проблем от Гърция и напрежението, което тя може да създаде на световните пазари е несъизмеримо по-високо. Допълнителна несигурност през юли внесе и крайното политическо противопоставяне в САЩ по отношение на вдигането на дълговия таван. Последниците от евентуално затруднение на САЩ при плащане на дълговите си задължения също е трудно измеримо.

Отражение върху финансовите акции имаше и от излезлите през месеца резултати от стрес тестовите на големите европейски банки. Като цяло при тях нямаше особени изненади, като голяма част от европейската банкова система би издържала при евентуално повторно влизане на икономиките в рецесия. Несигурността при стрес тестовите идва от това, че те не тестват банките как биха се справили при фалит на държавата от еврозоната. За сметка на това обявените резултати бях доста по-обширни отколкото при предходните подобни тестове като бяха обявени и експозициите по държави на отделните банки. Наличието на

тази информация би смекчило значително евентуална ликвидна криза, възникнала от недоверие между банките при евентуален неконтролиран фалит на държава.

Изменение	Q4 2009	Q1 2010	Q2 2010	Q3 2010	Q4 2010	Q1 2011	Q2 2011	Юни 2011	Юли 2011
ДФ Статус Финанси	-5.94%	8.27%	-11.26%	5.9%	0.05%	0.7%	-7.5%	-2.9%	-3.79%
CECE Banking Financial Index	5.4%	14.79%	-18.74%	16.8%	5.7%	2.96%	-2.45%	-2.04%	-5.67%

Стандартно отклонение

	Стандартно отклонение
ДФ Статус Финанси	11.21%
CECE Banking Financial Index	17.5%

Продажби и покупки на ценни книжа

През месеца не сме извършвали сделки с ценни книжа

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

Активи	31.5.2011	30.6.2011	31.7.2011	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	835 568	808 072	761 017	80.80%
Облигации	-	-	-	-
Парични средства	65 618	56 500	50 332	5.34%
Депозити до 3 мес.	115 865	115 865	117 531	12.48%
Вземания	2 831	3 317	12 032	1.28%
Други	1 047	879	918	0.10%
Общо:	1 020 930	984 633	941 830	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “Статус Финанси” акции

Company	30.6.2011			31.7.2011			
	Брой ценни книжа	Цена за брой	Балансова стойност	Брой ценни книжа	Цена за брой	Балансова стойност	Процент от активите
София Комерс - заложни къщи АД	5700	6.908	39375.6	5700	5.842	33299.4	3.5%
Сентинел рапид	17777.0253	1.2087	21487.09	17777.0253	1.2107	21522.64	2.3%
ДФ ОБЩИНСКА БАНКА - БАЛАНСИРАН	2535.5612	12.1354	30770.05	2535.5612	12.2265	31001.04	3.3%
CROATIA OSIGURANJE D.D.	32	1473.12	47139.88	32	1380.59	44178.79	4.7%
JADRANSKO OSIGURANJE D.D.	59	692.565	40861.35	59	713.435	42092.66	4.5%
Privredna Banka Zagreb D.D.	155	153.257	23754.91	155	152.522	23640.91	2.5%
ZAGREBACHKA BANKA D.D.	85	76.3645	6490.98	85	17.093	1452.9	0.2%
SIF OLTENIA CRAIOVA	45000	0.6365	28642.63	45000	0.61324	27595.94	2.9%
Agrobanka a.d. Beograd	110	150.014	16501.51	110	128.927	14181.93	1.5%
AIK banka a.d. Niš	1236	58.6006	72430.33	1236	50.0615	61876.06	6.6%
Dunav Osigurianje A.D.	258	30.541	7879.58	258	23.1348	5968.78	0.6%
Metals Banka AD Novi Sad	105	48.1021	5050.72	105	51.6894	5427.39	0.6%
T. Garanti Bankasi	10500	6.10885	64142.89	10500	6.08622	63905.3	6.8%
İŞ BANKASI (C)	8400	4.05315	34046.42	8400	3.95686	33237.61	3.5%
Haci Omer Sabanci Holding	7000	5.70936	39965.51	7000	5.40091	37806.35	4.0%
Türkiye Halk Bankasia A.S.	2100	9.98722	20973.15	2100	9.66779	20302.35	2.2%

Erste Bank AG	750	68.5518	51413.88	750	65.3052	48978.87	5.2%
Raiffeisen International Bank-Hold. AG	681	67.5544	46004.52	681	68.3269	46530.63	4.9%
VIENNA INSURANCE GROUP	500	72.2581	36129.07	500	72.4635	36231.75	3.8%
Allianz SE	220	185.628	40838.12	220	178.098	39181.53	4.2%
NBG	1200	9.40754	11289.05	1200	9.25108	11101.29	1.2%
Piraeus Bank S.A.	3471	2.09274	7263.89	3471	1.76025	6109.82	0.6%
AXA	1200	29.846	35815.16	1200	25.6409	30769.12	3.3%
BANCO BILBAO VISCAYA ARGENTARIA	2700	15.4413	41691.45	2700	14.3734	38808.17	4.1%
BANCO SANTANDER SA ORD	2500	15.2457	38114.24	2500	14.3265	35816.14	3.8%
Total:			808072			761017	80.8%

Хеджиращи сделки

Не са сключвани хеджиращи сделки и няма отворена хеджираща позиция.

Дата на съставяне:
10.07.2011 г.

Съставили:

Иван Иванов:

Мария Сивкова: