

ИНФОРМАЦИЯ

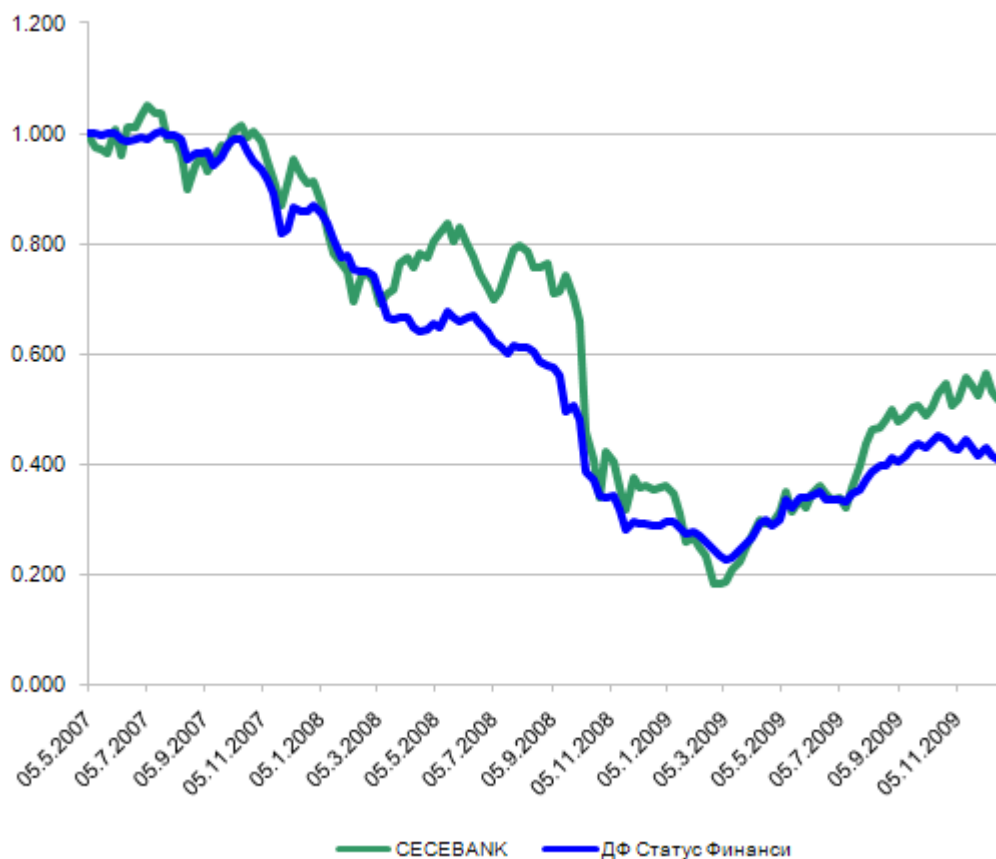
СЪГЛАСНО ИЗИСКВАНИЯТА НА ЧЛ. 48, АЛ. 3 ОТ НАРЕДБА № 25,

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

ЗА ПЕРИОДА ОТ 01.12.2009 Г. ДО 31.12.2009 Г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на месец декември нетните активи на Статус Финанси са 1 066 745.36 лв., което представлява намаление с -10 954.0900 лв. спрямо края на месец ноември. Броят на емитираните дялове намалява с -7 745.4548 и достига 2 592 170.8925 бр.



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

Основното за финансовия сектор, в който инвестира ДФ Статус Финанси, през месец декември бе стабилизирането на гръцкия пазар. След като рейтинга на Гърция бе намален това се отрази силно негативно на акциите на банковия сектор в Гърция. Големият бюджетен дефицит и значителното ниво на задлъжнялост на гръцкото правителство предизвика опасения, че бъдещото финансиране на публичните разходи в Гърция ще бъде силно затруднено. От друга страна намаления кредитен рейтинг е възможно да ограничи възможностите на гръцките банки да се финансират чрез ЕЦБ, като използват за обезпечение ДЦК издадени от гръцкото правителство. Това от своя страна би създавало ликвидни затруднения за банковата система в южната ни съседка.

В последствие стана ясно че ЕС няма намерение да остави Гърция да навлезе в подобна спирала и пазарите се успокоиха, като за отделни дни реализираха и значителни растежи спрямо дъната си.

Затрудненията на гръцката банкова система оказаха влияние и на пазарите на други страни от Балканите. Силното присъствие на гръцки банки в региона прехвърли тези негативи и в останалите страни, както по линията на изтегляне на ликвидност, така и заради нарастването на риска.

Изменение	Q2 2008	Q3 2008	Q4 2008	Q1 2009	Q2 2009	Q3 2009	Q4 2009	Декември 2009
ДФ Статус Финанси	-3.8%	-24.3%	-38.87%	-19.14%	39.00%	28.53%	-5.94%	-0.72%
CECE Banking Financial Index	-3.82%	-9.6%	-44.63%	-37.97%	51.66%	47.72%	5.4%	0.05%

Стандартно отклонение

	Стандартно отклонение
ДФ Статус Финанси	28.24%
CECE Banking Financial Index	51.28%

Покупки и продажби на ценни книжа

След значителното реструктуриране на портфейла през ноември, през декември не са извършвани покупки и продажби на ценни книжа

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

Активи	31.10.2009	30.11.2009	31.12.2009	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	808 172	857 210	748 876	70.15%
Облигации	-	-	-	-
Парични средства	404 193	176 553	109 275	10.24%
Депозити до 3 мес.	394 863	205 986	206 086	19.31%

Вземания	3 871	3 352	3 227	0.30%
Общо:	1 611 099	1 243 102	1 067 465	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “Статус Финанси” акции

Дружество	31.10.2009			30.11.2009			31.12.2009			
	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	81.30	69190	681	80.19	54609	681	77.255	52610.85	4.93%
Erste Bank AG				750	54.98	41234	750	50.969	38226.70	3.58%
КВС	400	60.44	24174	400	59.31	23724	400	59.408	23763.33	2.23%
София Комерс-заложни къщи АД	5700	3.81	21689	5700	3.65	20805	5700	3.7	21090.00	1.98%
ЦКБ АД	20000	1.52	30360							
ПЪРВА ИНВЕСТИЦИОННА БАНКА АД	12608	2.84	35845	12608	2.67	33714	5294	2.276	12049.14	1.13%
Akbank Turk AS	3800	7.56	28740	3800	6.98	26520				
T. Garanti Bankasi	12000	5.26	63160	12000	4.43	53109	12000	5.7259	68711.06	6.44%
Turkiye Halk Bankasia A.S.	3100	8.05	24954	3100	7.70	23878				
Asya Katilim Bankasi A.S.	12000	2.67	32058							
NBG	1271	47.72	60655	1000	39.33	39332	1000	35.401	35400.52	3.32%
Piraeus Bank S.A.	1021	22.96	23444	1021	18.76	19150	1021	15.823	16154.94	1.51%
Croatia Osiguranje D.D.	25	1487.94	37199	32	1336.41	42765	32	1338.4	42828.80	4.01%
Jadransko Osiguranje D.D.	59	674.98	39824	59	801.74	47303	59	707.09	41718.20	3.91%
Privredna Banka Zagreb D.D.				155	152.39	23621	155	151.77	23525.06	2.20%

ZAGREBACHKA BANKA D.D.				85	67.64	5749	85	69.597	5915.73	0.55%
BANK PEKAO SA				600	81.18	48706	600	76.67	46002.23	4.31%
PKO Bank Polski	1200	16.28	19535	1200	17.49	20983	1500	18.018	27026.66	2.53%
PKO Bank Polski - временни	300	15.17	4552	300	17.37	5210				
OTP	1100	38.85	42731	1100	37.96	41759	1100	39.217	43138.96	4.04%
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	5400	5.59	30179	5400	6.18	33386				
SIF Moldova Bacau	88000	0.44	38785	86500	0.50	43180	86500	0.53	45567	4.27%
SIF Oltenia Craiova	79000	0.49	38767	80500	0.57	46084	80500	0.59	47243	4.43%
Agrobanka a.d. Beograd	110	239.87	26385	110	178.15	19596	110	166.09	18270.08	1.71%
AIK banka a.d. Niš	1183	62.53	73968	1183	52.86	62533	1183	50.421	59648.07	5.59%
Metals Banka AD Novi Sad	105	180.71	18975	105	146.11	15342	105	149.71	15719.86	1.47%
Univezal banka A.D	17	177.82	3023	17	144.56	2458	17	159.14	2705.32	0.25%
Dunav Osiguranje A.D.	258	77.45	19982	258	70.22	18116	258	59.824	15434.59	1.45%
Unicredito Italiano				10000	4.43	44345	10000	4.6126	46126.10	4.32%
Общо:			808172			857210			748876	70.15%

Хеджиращи сделки

Не са сключвани хеджиращи сделки и няма отворена хеджираща позиция.

Дата на съставяне:
08.01.2010 г.

Съставили:

Иван Иванов:

Мария Сивкова: