

ИНФОРМАЦИЯ

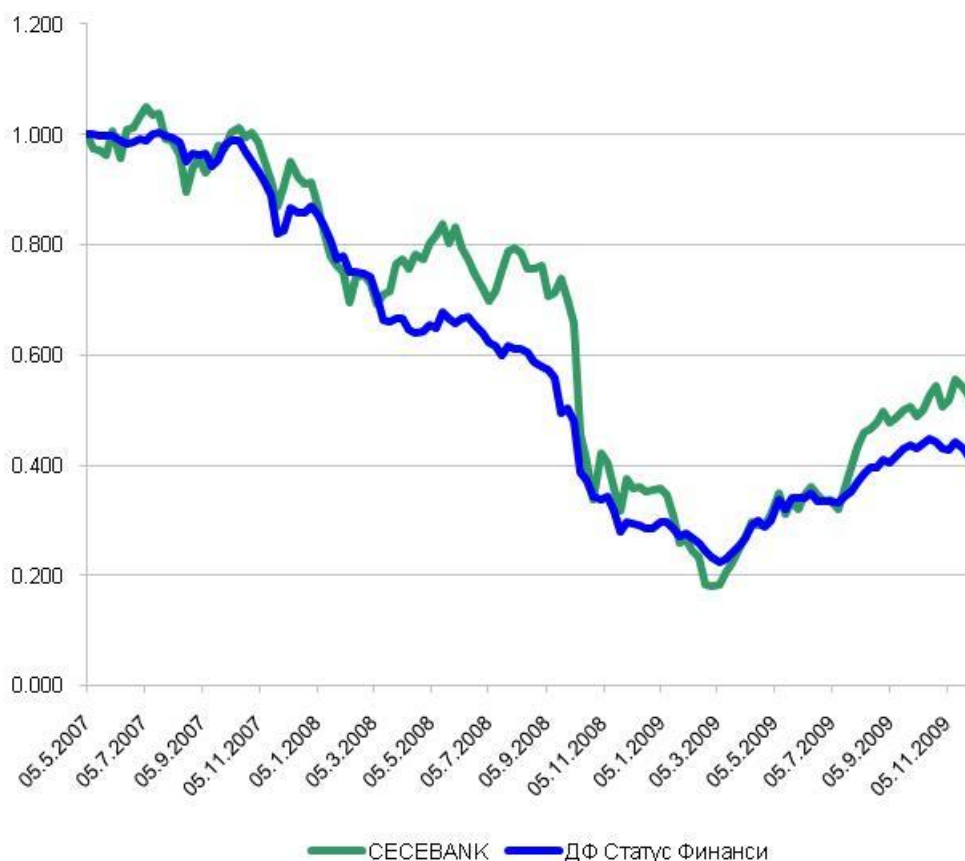
СЪГЛАСНО ИЗИСКВАНИЯТА НА ЧЛ. 48, АЛ. 3 ОТ НАРЕДБА № 25,

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

ЗА ПЕРИОДА ОТ 01.11.2009 Г. ДО 30.11.2009 Г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на месец ноември нетните активи на Статус Финанси са 1 077 699.45 лв., което представлява намаление с -524 759.67 лв. спрямо края на месец октомври. Броят на емитираните дялове намалява с -1 128 558.26 и достига 2 599 916.3473 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.

Очакваната от нас корекция през октомври премина в консолидация. През ноември продължихме изпълнението на стратегията ни да увеличаваме делът от инвестициите на фонда към банки от централна и западна Европа. Основно като намаляваме делът на инвестициите ни в Румъния и Турция.

Проблемите с Дубай и намалението на кредитния рейтинг на Гърция оказват влияние върху пазарните капитализации на финансовия сектор. Повишеният риск, който за момента се свързва с опасността от намаление на кредититни рейтинги и съответно повишавана на цената на привличане на ресурс създават колебания на пазара, поради които отново решихме да увеличим дела на ликвидните средства.

Изменение	Q2 2008	Q3 2008	Q4 2008	Q1 2009	Q2 2009	Q3 2009	Октомври 2009	Ноември 2009
ДФ Статус Финанси	-3.8%	-24.3%	-38.87%	-19.14%	39.00%	28.53%	-1.76%	-3.56%
CECE Banking Financial Index	-3.82%	-9.6%	-44.63%	-37.97%	51.66%	47.72%	0.87%	4.41%

Стандартно отклонение

	Стандартно отклонение
ДФ Статус Финанси	28.45%
CECE Banking Financial Index	53.36%

Покупки и продажби на ценни книжа

Продажби	Брой
Akbank Turk AS	3800
Asya Katilim Bankasi A.S.	12000
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	5400
NBG	671
Raiffeisen International Bank-Hold. AG	170
SIF Banat Crisana SA /SIF 1/	63000
SIF MOLDOVA BACAU	70000
SIF OLTENIA CRAIOVA	60000
SIF Transilvania SA /SIF 3/	104000
Turkiye Halk Bankasia A.S.	3100
ПЪРВА ИНВЕСТИЦИОННА БАНКА АД	7314
ЦКБ АД	20000

Част от сделките са с неприключил сетълмент към 30.11.2009 и поради това не са отразени в подробния портфейл на фонда по долу.

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

Активи	30.09.2009	31.10.2009	30.11.2009	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	839 502	808 172	857 210	68.96%
Облигации	-	-	-	-
Парични средства	297 407	404 193	176 553	14.20%
Депозити до 3 мес.	123 285	394 863	205 986	16.57%
Вземания	5 328	3 871	3 352	0.27%
Общо:	1 265 522	1 611 099	1 243 102	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ "Статус Финанси" акции

Дружество	30.09.2009			31.10.2009			30.11.2009			
	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	84.30	71736	851	81.30	69190	681	80.19	54609	4.39%
Erste Bank AG							750	54.98	41234	3.32%
КВС	400	67.69	27077	400	60.44	24174	400	59.31	23724	1.91%
София Комерс-заложни къщи АД	5700	3.80	21660	5700	3.81	21689	5700	3.65	20805	1.67%
ЦКБ АД	20000	1.49	29720	20000	1.52	30360				
ПЪРВА ИНВЕСТИЦИОННА БАНКА АД	12608	2.97	37458	12608	2.84	35845	12608	2.67	33714	2.71%
Akbank Turk AS	3800	7.69	29238	3800	7.56	28740	3800	6.98	26520	2.13%
T. Garanti Bankasi	12000	5.22	62633	12000	5.26	63160	12000	4.43	53109	4.27%
Turkiye Halk Bankasia A.S.	3100	7.96	24689	3100	8.05	24954	3100	7.70	23878	1.92%
Asya Katilim Bankasi A.S.	12000	2.86	34340	12000	2.67	32058				

NBG	1271	47.92	60904	1271	47.72	60655	1000	39.33	39332	3.16%
Piraeus Bank S.A.	1021	24.29	24802	1021	22.96	23444	1021	18.76	19150	1.54%
Croatia Osiguranje D.D.	25	1266.53	31663	25	1487.94	37199	32	1336.41	42765	3.44%
Jadransko Osiguranje D.D.	59	886.56	52307	59	674.98	39824	59	801.74	47303	3.81%
Privredna Banka Zagreb D.D.							155	152.39	23621	1.90%
ZAGREBACHKA BANKA D.D.							85	67.64	5749	0.46%
BANK PEKAO SA							600	81.18	48706	3.92%
PKO Bank Polski	1200	15.36	18429	1200	16.28	19535	1200	17.49	20983	1.69%
PKO Bank Polski - временни				300	15.17	4552	300	17.37	5210	0.42%
OTP	1100	38.45	42294	1100	38.85	42731	1100	37.96	41759	3.36%
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	5400	5.84	31549	5400	5.59	30179	5400	6.18	33386	2.69%
SIF Moldova Bacau	88000	0.55	48149	88000	0.44	38785	86500	0.50	43180	3.47%
SIF Oltenia Craiova	79000	0.60	47254	79000	0.49	38767	80500	0.57	46084	3.71%
Agrobanka a.d. Beograd	110	215.43	23697	110	239.87	26385	110	178.15	19596	1.58%
AIK banka a.d. Niš	1183	64.85	76717	1183	62.53	73968	1183	52.86	62533	5.03%
Metals Banka AD Novi Sad	105	183.83	19302	105	180.71	18975	105	146.11	15342	1.23%
Univezal banka A.D	17	192.28	3269	17	177.82	3023	17	144.56	2458	0.20%
Dunav Osiguranje A.D.	258	79.91	20616	258	77.45	19982	258	70.22	18116	1.46%
Unicredito Italiano							10000	4.43	44345	3.57%
Общо:			839502			808172			857210	68.96%

Хеджиращи сделки

Не са сключвани хеджиращи сделки и няма отворена хеджираща позиция.

Дата на съставяне:
10.12.2009 г.

Съставили:

Иван Иванов:

Мария Сивкова: