

## **ИНФОРМАЦИЯ**

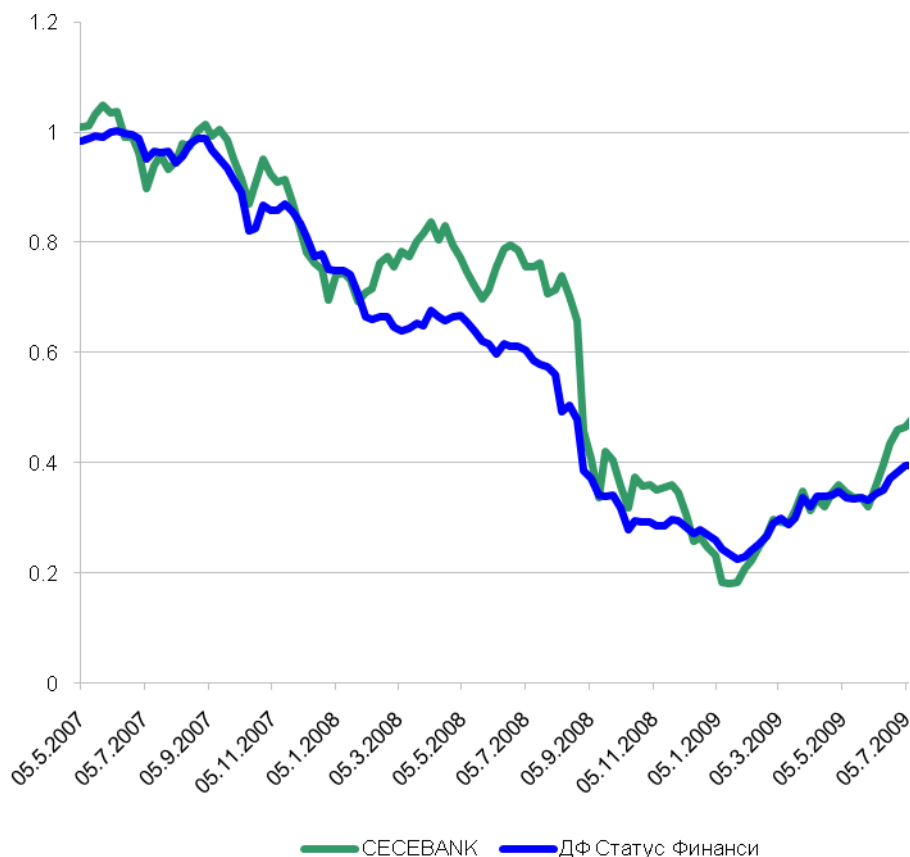
**СЪГЛАСНО ИЗИСКВАНИЯТА НА ЧЛ. 48, АЛ. 3 ОТ НАРЕДБА № 25,**

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

**ЗА ПЕРИОДА ОТ 01.09.2009 Г. ДО 30.09.2009 Г.**

## Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на месец септември нетните активи на Статус Финанси са 1 261 259.11 лв., което представлява увеличение с 132 575.63 лв. спрямо края на месец август. Броят на емитираните дялове се увеличава със 135 000.5676 и достига 2 882 860.9730 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.

През месеца продължи растежа на пазарните капитализации на финансовите компании на пазарите, на които инвестира ДФ Статус Финанси. Турските банки и тези в България бяха между малкото, които навлязоха в период на консолидация, като за турския пазар това бе до голяма степен очаквано поради значителните растежи през предходните месеци. Поради тази причина допълнително намалихме делът на инвестициите в Турция до около 12%, което смятаме за оптимално към настоящия момент. В същото време поради преодоляването на най-непредсказуемата и от там деструктивна за стойността фаза на настоящия борсов цикъл, смятаме че постепенно пазарите ще започнат да калкулират все повече очаквания за реални резултати и все по-малко компенсация на предишни спадове. В такива условия намираме, че допълнителна диверсификация би била изключително полезна

за постигане на по-добро съотношение риск/доходност. Поради тази причина и направихме инвестиция в полската РКО, като при подходящи нива смятаме да увеличим допълнително процента на инвестираните в акции активи. Увеличаването на паричните средства до над 20% свободни за инвестиране ликвидни средства ни дава възможността за бърза реакция и в същото време създава известен буфер, ако след бурния растеж повече пазари навлезат в консолидация или корекция.

Изменение	Q1 2008	Q2 2008	Q3 2008	Q4 2008	Q1 2009	Q2 2009	Q3 2009	септември 2009
<b>ДФ Статус Финанси</b>	-23.6%	-3.8%	-24.3%	-38.87%	-19.14%	39.00%	28.53%	6.53%
<b>CECE Banking Financial Index</b>	-18.05%	-3.82%	-9.6%	-44.63%	-37.97%	51.66%	47.72%	1.32%

### Стандартно отклонение

	Стандартно отклонение
ДФ Статус Финанси	33.42%
CECE Banking Financial Index	70.88%

### Покупки и продажби на ценни книжа

Покупки	Брой
PKO Bank Polski	1200

Продажби	Брой
Akbank Turk AS	1200
Turkiye Halk Bankasia A.S.	1000
T. Garanti Bankasi	4000

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

Активи	31.07.2009	31.08.2009	30.09.2009	Структура на активите спрямо общата им стойност /%
Акции и права	612 475	778 161	839 502	66.34%
Облигации	-	-	-	-
Парични средства	145 595	223 630	297 407	23.50%
Депозити до 3 мес.	123 065	123 187	123 285	9.74%
Вземания	8 536	4 230	5 328	0.42%
<b>Общо:</b>	<b>889 671</b>	<b>1 129 208</b>	<b>1 265 522</b>	<b>100.00%</b>

**Стойност на притежаваните от ДФ "Статус Финанси" акции**

Дружество	31.07.2009			31.08.2009			30.09.2009			
	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	67.902	52678.62	851	74.67	63547	851	84.30	71736	5.67%
КВС	400	28.555	11422.05	400	53.79	21514	400	67.69	27077	2.14%
София Комерс-заложни къщи АД	5700	4.00	22800.00	5700	3.85	21945	5700	3.80	21660	1.71%
ЦКБ АД	-	-	-	20000	1.58	31520	20000	1.49	29720	2.35%
ПЪРВА ИНВЕСТИЦИОННА БАНКА АД	-	-	-	12608	2.99	37635	12608	2.97	37458	2.96%
Akbank Turk AS	5000	7.778	38891.68	5000	7.97	39836	3800	7.69	29238	2.31%
T. Garanti Bankasi	18700	4.836	90427.38	16000	5.24	83769	12000	5.22	62633	4.95%
Turkiye Halk Bankasina A.S.	4100	7.263	29777.91	4100	7.47	30612	3100	7.96	24689	1.95%
Asya Katilim Bankasi A.S.	12000	2.568	30813.46	12000	2.59	31031	12000	2.86	34340	2.71%

NBG	1040	38.784	40335.47	1271	45.61	57970	1271	47.92	60904	4.81%
Piraeus Bank S.A.	1021	16.331	16674.14	1021	21.83	22285	1021	24.29	24802	1.96%
Croatia Osiguranje D.D.	25	970.426	24260.66	25	1062.37	26559	25	1266.53	31663	2.50%
Jadransko Osiguranje D.D.	59	585.235	34528.88	59	756.81	44652	59	886.56	52307	4.13%
PKO Bank Polski							1200	15.36	18429	1.46%
OTP	1100	28.252	31076.94	1100	35.04	38541	1100	38.45	42294	3.34%
BRD-Groupe Societe Generale Bucuresti	5400	4.822	26037.57	5400	5.93	32006	5400	5.84	31549	2.49%
SIF Moldova Bacau	88000	0.371	32639.69	88000	0.47	41156	88000	0.55	48149	3.80%
SIF Oltenia Craiova	79000	0.436	34429.31	79000	0.55	43166	79000	0.60	47254	3.73%
Agrobanka a.d. Beograd	110	133.245	14656.99	110	197.51	21726	110	215.43	23697	1.87%
AIK banka a.d. Niš	1036	44.093	45680.69	1036	51.90	53773	1183	64.85	76717	6.06%
Metals Banka AD Novi Sad	105	117.526	12340.26	105	130.29	13680	105	183.83	19302	1.53%
Univezal banka A.D	17	132.217	2247.69	17	164.96	2804	17	192.28	3269	0.26%
Dunav Osiguranje A.D.	258	67.913	17521.65	258	71.45	18433	258	79.91	20616	1.63%
NBG - права	1040	3.11	3234.16	-	-	-	-	-	-	
<b>Общо:</b>			<b>612475.2</b>			<b>778161</b>			<b>839502</b>	<b>66.34%</b>

### Хеджиращи сделки

Не са сключвани хеджиращи сделки и няма отворена хеджираща позиция.

**Дата на съставяне:**  
09.10.2009 г.

**Съставили:**

Иван Иванов:

Мария Сивкова: