

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 01.11.2011 г. до 30.11.2011 г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на месец ноември нетните активи на Статус Финанси са 688 457.69 лв., което представлява намаление с 84 471.67 лв. спрямо края на месец октомври. Броят на емитираните дялове намалява с 56 321.7817 и достига 2 320 851.8490 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 ноември дълговата криза в Европа достигна опасна точка. Лихвите по дългосрочните облигации на Италия преминаха 7%, същевременно се увеличи доходността и на испанските, френските и дори немските облигации. По този начин кризата започнала в периферията на Евронзоната се придвижи вече и до сърцето на Европа. Пазарите в дадени моменти през месеца се намираха на границата на паника, като само намесата на ЕЦБ за лимитирано изкупуване на италиански облигации успяваше да върне пазара в по-спокойно състояние. Проблемът с увеличаваща се доходност на държавните облигации на вторичен пазар е свързан с това че тези високи лихви се пренасят и на първичния пазар, или с други думи директно влияят на цената, на която държавите се финансират. Повишението на цената на финансиране създава напрежение за това до колко държавите от южна Европа и особено Италия ще успеят да рефинансират падежите през следващата година на своите ДЦК. В същото време това, че ЕЦБ (за разлика от Федералния резерв и от Английската централна банка) не купува ДЦК на първичен пазар създава сериозни съмнения в разглежданите до момента като безрискови италиански ценни книжа. Преминаването на над 1,9 трилиона дълг от категорията на безрисков в рисков води след себе си значителни последици за всички държаващи подобни ДЦК, като това в особена степен се отнася до банките. Банките са и пътя на евентуално финансово заразяване към Франция и дори Германия.

Всички тези опасения за това как ще се развие дълговата криза, какви мерки ще предприеме както ЕС, така и ЕЦБ, значително повишиха несигурността на капиталовите пазари, като това се отрази негативно и на банковите акции. През месеца намалихме експозицията на ДФ Статус Финанси към финансови компании от Еврозоната, като при липса на категорично разрешение на кризата (издаване на общи облигации или силна намеса на ЕЦБ) смятаме да продължим с намаляването на дела на инвестициите в Еврозоната, въпреки изключително ниските коефициенти на търговия на финансовите компании.

Изменение	Q1 2010	Q2 2010	Q3 2010	Q4 2010	Q1 2011	Q2 2011	Q2 2011	Ноември 2011
ДФ Статус Финанси	8.27%	-11.26%	5.9%	0.05%	0.7%	-7.5%	-17.2%	-8.77%
CECE Banking Financial Index	14.79%	-18.74%	16.8%	5.7%	2.96%	-2.45%	-34.9%	-10.35%

Стандартно отклонение

	Стандартно отклонение
ДФ Статус Финанси	16.68%
CECE Banking Financial Index	32.68%

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

Активи	30.9.2011	31.10.2011	30.11.2011	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	657 787	643 122	555 203	80.39%
Облигации	-	-	-	-
Парични средства	11 720	11 989	15 381	2.23%
Депозити до 3 мес.	117 531	119 220	119 220	17.26%
Вземания	3 272	720	675	0.10%
Други	552	366	186	0.03%
Общо:	790 861	775 417	690 665	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “Статус Финанси” акции

Company	31.10.2011			30.10.2011			
	Брой ценни книжа	Цена за брой	Балансова стойност	Брой ценни книжа	Цена за брой	Балансова стойност	Процент от активите
София Комерс - заложни къщи АД	1825	5.99	10931.75	1825	5.48	10001	1.4%
Сентинел рапид	17777.0253	1.22	21615.09	17777.0253	1.22	21652.42	3.1%
ДФ ОБЩИНСКА БАНКА - БАЛАНСИРАН	2535.5612	12.41	31465.3	2535.5612	12.46	31600.7	4.6%
CROATIA OSIGURANJE D.D.	32	1333.31	42665.85	32	1094.90	35036.74	5.1%
JADRANSKO OSIGURANJE D.D.	59	717.43	42328.1	59	753.39	44450.25	6.4%
Privredna Banka Zagreb D.D.	155	131.75	20420.54	155	125.14	19396.14	2.8%
ZAGREBACHKA BANKA D.D.	425	11.48	4878.49	425	10.43	4431.73	0.6%
SIF OLTENIA CRAIOVA	45000	0.42	19034.7	45000	0.46	20620.8	3.0%
SIF MOLDOVA BACAU	80000	0.36	29056.83	80000	0.41	32490.12	4.7%
Agrobanka a.d. Beograd	121	78.58	9507.65	121	64.95	7859.37	1.1%
AIK banka a.d. Niš	1236	34.61	42773.94	1236	28.23	34898.37	5.1%
Dunav Osigurianje A.D.	258	18.49	4770.59	258	20.69	5338.49	0.8%
Metals Banka AD Novi Sad	105	41.56	4363.31	105	30.06	3156.25	0.5%
T. Garanti Bankasi	10500	5.06	53173.58	10500	4.73	49709.92	7.2%
İŞ BANKASI (C)	8400	3.38	28359.24	8400	2.85	23954.18	3.5%

Haci Omer Sabanci Holding	7000	4.94	34557.25	7000	4.40	30804.58	4.5%
Türkiye Halk Bankasia A.S.	2100	9.00	18895.01	2100	8.30	17431.84	2.5%
Erste Bank AG	750	33.44	25083.52	750	24.00	17998.53	2.6%
Raiffeisen International Bank-Hold. AG	681	43.52	29635.23	681	32.20	21930.07	3.2%
VIENNA INSURANCE GROUP	500	62.21	31107.48	500	53.24	26618.85	3.9%
Allianz SE	220	162.55	35760.79	220	142.52	31354.69	4.5%
NBG	1200	3.74	4482.76	1200	3.74	4482.76	0.6%
Piraeus Bank S.A.	3471	0.49	1690.38	3471	0.53	1846.52	0.3%
AXA	1200	23.81	28574.68				
BANCO BILBAO VISCAYA ARGENTARIA	2700	13.55	36574.41	2700	11.59	31304.23	4.5%
BANCO BILBAO VISCAYA ARGENTARIA права	2500	0.00	0.01				
BANCO SANTANDER SA ORD	2500	12.57	31415.52	2500	10.73	26833.99	3.9%
Total:			643122			555203	80.4%

Хеджиращи сделки

Не са сключвани хеджиращи сделки и няма отворена хеджираща позиция.

Дата на съставяне:
09.12.2011 г.

Съставили:

Иван Иванов:

Мария Сивкова: