

## **ИНФОРМАЦИЯ**

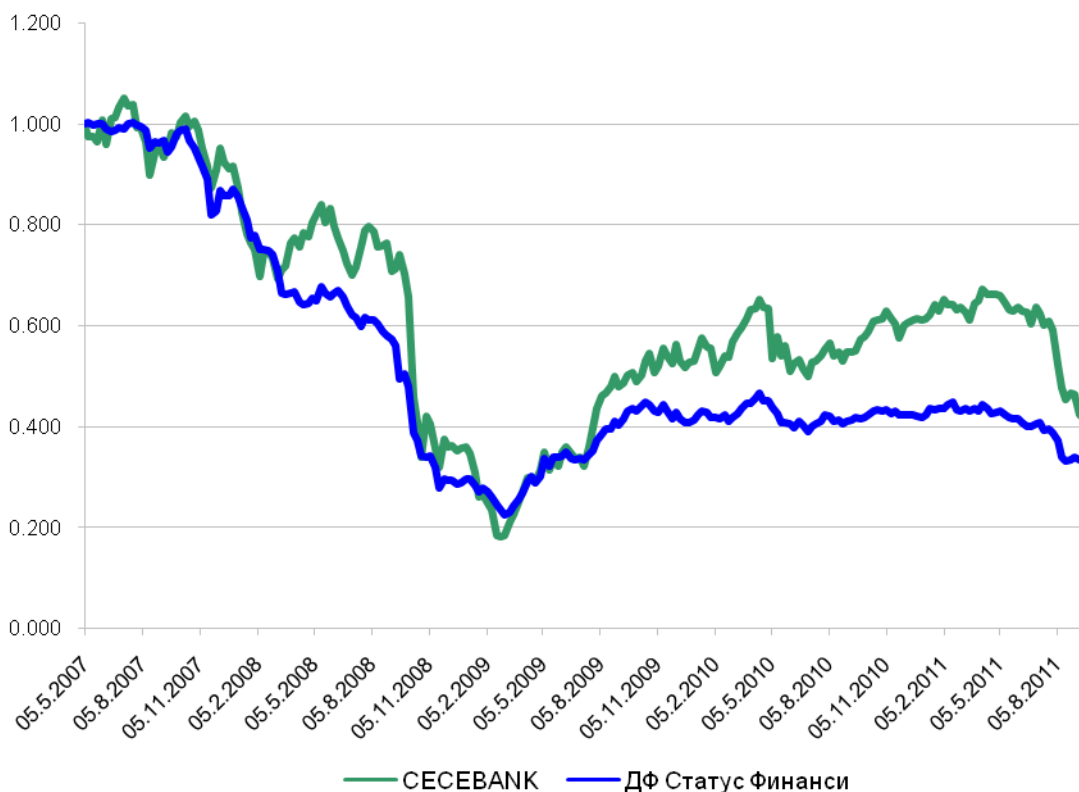
**СЪГЛАСНО ИЗИСКВАНИЯТА НА ЧЛ. 48, АЛ. 3 ОТ НАРЕДБА № 25,**

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

**ЗА ПЕРИОДА от 01.9.2011 г. до 30.9.2011 г.**

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

Към края на месец септември нетните активи на Статус Финанси са 790 356.02 лв., което представлява намаление с 21 209.37 лв. спрямо края на месец август. Броят на емитираните дялове се увеличава с 450.85 и достига 2379872.92 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 септември се запази напрежението около начина за справяне с дълговата криза в еврозоната. Разнопосочните сигнали от политици за това как планират да се справят с проблемите допълнително увеличава несигурността на пазарите, като опасността от прехвърляне на кризата и върху банковия сектор в Европа нарастна. Наличието на сигнали за намаляваща ликвидност на междубанковия пазар и бягството към сигурност на значителни по обем капитали оказва сериозен натиск върху глобалните пазари.

Подобно негативно развитие увеличава шансовете и за глобална криза, подобна на тази след фалита на Лемън Брадърс. Разбира се има и немалко различия. Към момента основният проблем е свързан с държавни облигации, които е много по-лесно да бъдат оценявани от синтетичните инструменти, от които тръгна първата криза. Правителствата, макар и да действат мудро и нерешително към момента, вече имат опит в справянето с подобни ликвидни кризи. Въпреки това е трудно да се очаква пазарен ръст без ясен и достатъчно адекватен сценарий за справяне с дълговите проблеми и пресичане на възможността от заразяване на световната икономика.

Въпреки насочеността на ДФ Статус Финанси към финансовия сектор, където отново след 2008 г. постепенно се насочва епицентъра на кризата, резултатите на Фонда за месеца са по-скоро добри. При спад на CECE Banking Financial Index от над 16% за месеца, ДФ Статус Финанси отбелязва спад от само 2.6% и то при над 80% от активите инвестирани в акции. По-добрата географска диверсификация на Фонда спрямо бенчмарка определено помага за намаляване на риска при подобни събития.

Изменение	Q1 2010	Q2 2010	Q3 2010	Q4 2010	Q1 2011	Q2 2011	Q2 2011	Септември 2011
<b>ДФ Статус Финанси</b>	8.27%	-11.26%	5.9%	0.05%	0.7%	-7.5%	-17.2%	-2.6%
<b>CECE Banking Financial Index</b>	14.79%	-18.74%	16.8%	5.7%	2.96%	-2.45%	-34.9%	-16.48%

### Стандартно отклонение

	Стандартно отклонение
ДФ Статус Финанси	14.87%
CECE Banking Financial Index	28.83%

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

Активи	31.7.2011	31.8.2011	30.9.2011	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	761 017	677 428	657 787	83.17%
Облигации	-	-	-	-
Парични средства	50 332	16 486	11 720	1.48%
Депозити до 3 мес.	117 531	117 531	117 531	14.86%
Вземания	12 032	2 247	3 272	0.41%
Други	918	732	552	0.07%
<b>Общо:</b>	<b>941 830</b>	<b>814 423</b>	<b>790 861</b>	<b>100.00%</b>

**Стойност на притежаваните от ДФ “Статус Финанси” акции**

Company	31.8.2011			30.9.2011			
	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	5.483	10006.48	1825	5.70	10402.5	1.3%
Сентинел рапид	17777.0253	1.2127	21558.2	17777.0253	1.21	21584.86	2.7%
ДФ ОБЩИНСКА БАНКА - БАЛАНСИРАН	2535.5612	12.3281	31258.65	2535.5612	12.35	31304.29	4.0%
CROATIA OSIGURANJE D.D.	32	1424.07	45570.27	32	1329.99	42559.82	5.4%
JADRANSKO OSIGURANJE D.D.	59	705.529	41626.21	59	782.39	46160.72	5.8%
Privredna Banka Zagreb D.D.	155	141.106	21871.4	155	133.01	20615.84	2.6%
ZAGREBACHKA BANKA D.D.	425	13.8231	5874.83	425	11.79	5009.87	0.6%
SIF OLTENIA CRAIOVA	45000	0.47647	21441.08	45000	0.44	19652.55	2.5%
SIF MOLDOVA BACAU	80000	0.41685	33348.17	80000	0.38	30269.9	3.8%
Agrobanka a.d. Beograd	121	108.974	13185.89	121	88.13	10664.01	1.3%
AIK banka a.d. Niš	1236	44.1095	54519.4	1236	37.12	45875.98	5.8%
Dunav Osigurianje A.D.	258	20.6396	5325.03	258	17.86	4608.48	0.6%
Metals Banka AD Novi Sad	105	48.7496	5118.71	105	41.02	4307.25	0.5%
T. Garanti Bankasi	10500	4.92122	51672.79	10500	5.74	60217.74	7.6%
İŞ BANKASI (C)	8400	3.46686	29121.66	8400	3.72	31221.59	3.9%
Haci Omer Sabanci Holding	7000	4.77971	33457.99	7000	5.08	35563.37	4.5%

Turkiye Halk Bankasia A.S.	2100	8.45097	17747.04	2100	9.93	20863.48	2.6%
Erste Bank AG	750	48.2405	36180.41	750	39.12	29337.45	3.7%
Raiffeisen International Bank-Hold. AG	681	56.1812	38259.41	681	45.67	31100.34	3.9%
VIENNA INSURANCE GROUP	500	61.5304	30765.21	500	55.96	27978.15	3.5%
Allianz SE	220	133.192	29302.25	220	141.80	31195.49	3.9%
NBG	1200	6.59115	7909.38	1200	5.42	6501.18	0.8%
Piraeus Bank S.A.	3471	1.48643	5159.4	3471	0.92	3190.68	0.4%
AXA	1200	20.7514	24901.63	1200	20.12	24138.85	3.1%
BANCO BILBAO VISCAYA ARGENTARIA	2700	11.9149	32170.27	2700	12.30	33215.86	4.2%
BANCO BILBAO VISCAYA ARGENTARIA права				2700	0.00	0.01	0.0%
BANCO SANTANDER SA ORD	2500	12.0303	30075.78	2500	12.10	30246.91	3.8%
<b>Total:</b>			677428			657787	83.2%

### Хеджиращи сделки

Не са сключвани хеджиращи сделки и няма отворена хеджираща позиция.

**Дата на съставяне:**  
10.10.2011 г.

**Съставили:**

Иван Иванов:

Мария Сивкова: