

ИНФОРМАЦИЯ

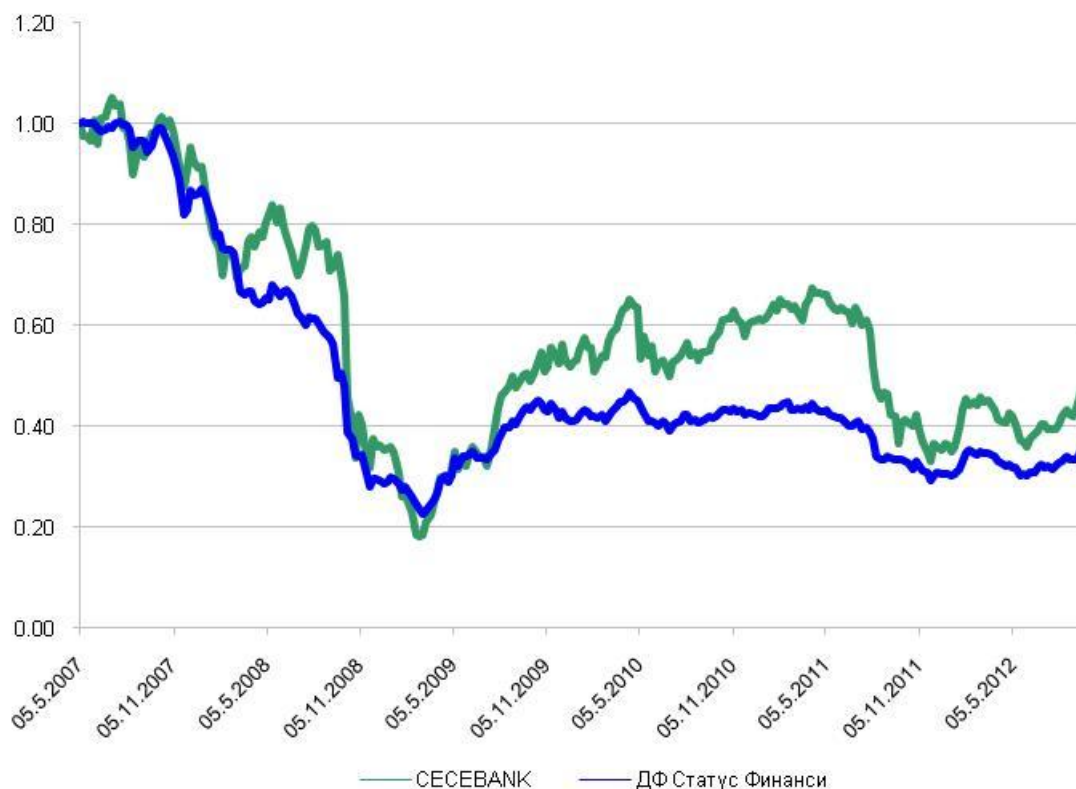
СЪГЛАСНО ИЗИСКВАНИЯТА НА ЧЛ. 72, АЛ. 2 ОТ НАРЕДБА № 44,

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

ЗА ПЕРИОДА от 01.9.2012 г. до 30.9.2012 г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на месец август нетните активи на Статус Финанси са 968 075.56 лв., което представлява увеличение от 118 847.82 лв. спрямо края на месец август. Броят на емитираните дялове се увеличава с 360 408.6825 и достига 2 908 938.1583.



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

Септември се оказва месец пълен с позитивни новини за Европа. ЕЦБ обяви, че ще купува неограничено на вторичен пазар краткосрочни облигации на държави от еврозоната, които поискат помощ. Така ЕЦБ реално действа като кредитор от последна инстанция на затруднени държави от еврозоната. Тези действия на ЕЦБ фактически ще намалят доходностите по ДЦК на тези държави, като реално изолират до голяма степен затруднените правителства от пазарен натиск за излизане от еврозоната и по този начин правят катастрофичния сценарии много по-слабо вероятен. А самото намаляване на вероятността от излизане от еврозоната на отделни държави вече е силно оптимистична новина.

Отново през септември германския конституционен съд даде зелена светлина на ESM Европейския механизъм за стабилност, като по този начин възможностите на Еврозоната за спасяване на затруднени държави нарастват от 148 на 400 милиарда евро. По този начин ESM вече е възможно да помага дори и на по-големите държави от Еврозоната за финансиране, а същевременно ЕЦБ да купува на вторичен пазар техни облигации. И двата механизма са реално поемане на общи гаранции от правителствата в Еврозоната, макар и по косвен начин.

В САЩ отново през септември ФЕД реши да предприеме QE3, като купува по 40 милиарда облигации на месец, до като възстановяването на икономиката е стабилно.

Изменение	Q1 2011	Q2 2011	Q3 2011	Q4 2011	Q1 2012	Q2 2012	Q3 2012	Септември 2012
ДФ Статус Финанси	0.7%	-7.5%	-17.2%	-8.7%	11.87%	-5.28%	3.58%	-0.12%
CECE Banking Financial Index	2.96%	-2.45%	-34.9%	-11.05%	19.3%	-7%	9.4%	4.9%

Стандартно отклонение

	Стандартно отклонение
ДФ Статус Финанси	17.49%
CECE Banking Financial Index	32.26%

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

Активи	31.7.2012	31.8.2012	30.9.2012	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	721 379	755 393	707 570	72.80%
Облигации	-	-	-	-
Парични средства	118 624	8 179	175 628	18.07%
Депозити до 3 мес.	125 225	85 234	85 234	8.77%
Вземания	5 500	2 745	2 939	0.30%
Други	907	723	545	0.06%
Общо:	971 635	852 274	971 916	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “Статус Финанси” акции

Company	31.8.2012			30.9.2012			
	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	5.317	9703.53	1825	5.096	9300.2	1.0%
Сентинел рапид	17777.025	1.2368	21986.62	17777.0253	1.2401	22045.29	2.3%
CROATIA OSIGURANJE D.D.	32	1580.7888	50585.24	19	1536.444	29192.44	3.0%
JADRANSKO OSIGURANJE D.D.	29	742.23792	21524.9	29	682.864	19803.06	2.0%
Privredna Banka Zagreb D.D.	155	151.1982612	23435.73	155	134.487438	20845.55	2.1%
ZAGREBACHKA BANKA D.D.	425	10.1521188	4314.65	425	10.085376	4286.28	0.4%
SIF OLTENIA CRAIOVA	80000	0.574484133	45958.73	80000	0.56886852	45509.48	4.7%
SIF MOLDOVA BACAU	45000	0.597708892	26896.9	45000	0.59989771	26995.4	2.8%
Agrobanka a.d. Beograd	121	0.000082645	0.01	121	8.2645E-05	0.01	0.0%
AIK banka a.d. Niš	1256	22.62092566	28411.88	1256	23.1233813	29042.97	3.0%
Dunav Osigurianje A.D.	258	12.38371843	3195	258	11.0176111	2842.54	0.3%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	950	18.16278703	17254.65	950	15.4722625	14698.65	1.5%
Metals Banka AD Novi Sad	105	9.659300373	1014.23	105	7.65111882	803.37	0.1%
T. Garanti Bankasi	10500	6.6556776	69884.61	10500	6.3219075	66380.03	6.8%

İŞ BANKASI (C)	8400	4.72723768	39708.8	8400	4.75407444	39934.23	4.1%
Haci Omer Sabanci Holding	7000	6.67274344	46709.2	7000	6.64221748	46495.52	4.8%
Turkiye Halk Bankasia A.S.	2100	13.9939888	29387.38	2100	11.800894	24781.88	2.5%
Erste Bank AG	1330	31.4106298	41776.14	1330	33.962988	45170.77	4.6%
Raiffeisen International Bank-Hold. AG	981	51.99574055	51007.82	500	55.1250686	27562.53	2.8%
KBC	1200	33.80652155	40567.83	1200	36.5153461	43818.42	4.5%
NBG	1200	2.7577203	3309.26	1200	3.6769604	4412.35	0.5%
Piraeus Bank S.A.	3471	0.49482499	1717.54	3471	0.69627548	2416.77	0.2%
BANCO SANTANDER SA ORD	2578	11.0895561	28588.88	2578	11.3340349	29219.14	3.0%
BANCOO BILBAO VISCAYA ARGENTARIA	2700	11.87775559	32069.94	2700	11.9559888	32281.17	3.3%
Intesa Sanpaolo	12000	2.40762673	28891.52	12000	2.31374689	27764.96	2.9%
SHS UNICREDIT SPA ORD REG	9400	6.072265401	57079.29	9400	6.32124256	59419.68	6.1%
BNP Paribas	450	67.58370565	30412.67	450	72.3265934	32546.97	3.3%
Total:			755393			707569.66	72.8%

Сделки с деривати и хеджиращи сделки

Фонда не притежава деривативни инструменти и не са сключвани сделки с такива.

Не са сключвани хеджиращи сделки и няма отворена хеджираща позиция.

Дата на съставяне:
10.10.2012 г.

Съставил:

Иван Иванов: