

## **ИНФОРМАЦИЯ**

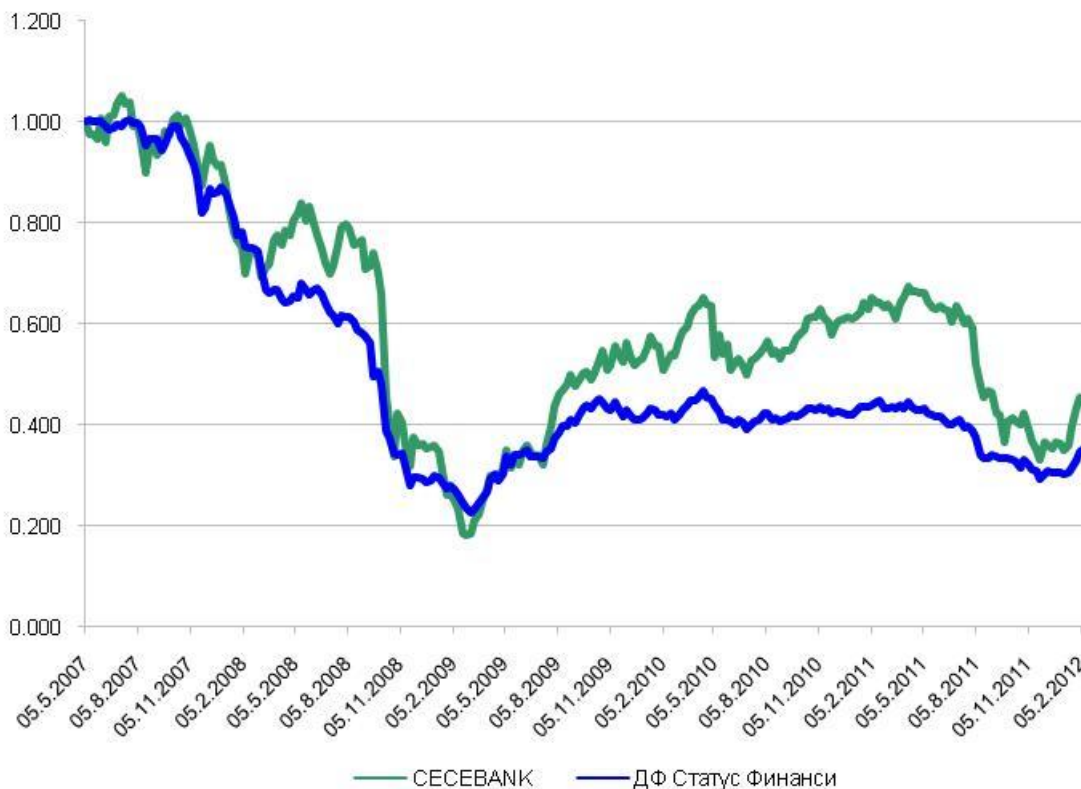
**СЪГЛАСНО ИЗИСКВАНИЯТА НА ЧЛ. 72, АЛ. 2 ОТ НАРЕДБА № 44,**

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

**ЗА ПЕРИОДА от 01.2.2012 г. до 29.2.2012 г.**

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

Към края на месец февруари нетните активи на Статус Финанси са 933 232.03 лв., което представлява увеличение с 175 144.62 лв. спрямо края на месец януари. Броят на емитираните дялове се увеличава с 465 224.7083 и достига 2 719 377.5718 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 февруари продължи подобряването на капиталовите пазари започнало в началото на годината. В края на месеца ЕЦБ осъществи и втората част от програмата си за дългосрочно кредитиране на банките като и този път банките взеха почти 530 милиарда евро, което значително увеличи ликвидността в банковата система в Еврозоната. Действията на ЕЦБ намалиха значително и усещането за риск, свързан с държавните дългове. През февруари доходността на италианските десет годишни облигации падна от 6% в края на януари до 5,19% към края на февруари. И вече е значително под върховете си стойности от над 7% в началото на годината. Постепенното решаване и на въпроса с гръцкия дълг също въздейства позитивно, макар че едва ли може да се очаква, че сделката за замяната на гръцките облигации и отписването на част от дълга ще подобри бързо състоянието на гръцката икономика и държавни финанси. От другата страна на Атлантика, Американската икономика вече показва устойчиво увеличение на заетостта и дава надежда, че повторното и връщане към рецесия няма да се състои.

Най-общо казано икономическото положение се подобрява в развитите икономики като това се отразява и на капиталовите им пазари. До колко ще продължи този позитивен тренд ще зависи до голяма степен от скоростта на подобрене и до колко темповете съвпадат с очакванията на пазарните участници.

През февруари увеличихме дела на акции в портфейла на ДФ Статус Финанси като закупихме акции на BNP Paribas, Intesa Sanpaolo и KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD. Като запазихме дела на акциите над 70%.

Изменение	Q3 2010	Q4 2010	Q1 2011	Q2 2011	Q3 2011	Q4 2011	Януари 2012	Февруари 2012
<b>ДФ Статус Финанси</b>	5.9%	0.05%	0.7%	-7.5%	-17.2%	-8.7%	10.92%	4.35%
<b>CECE Banking Financial Index</b>	16.8%	5.7%	2.96%	-2.45%	-34.9%	-11.05%	19.01%	4.55%

### Стандартно отклонение

	Стандартно отклонение
ДФ Статус Финанси	19.05%
CECE Banking Financial Index	36.12%

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

Активи	31.12.2011	31.1.2012	29.2.2012	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	477 453	542 875	675 859	72.06%
Облигации	-	-	-	-
Парични средства	39 043	95 210	139 188	14.84%
Депозити до 3 мес.	119 220	122 152	122 152	13.02%
Вземания	2 688	583	498	0.05%
Други	0	297	251	0.03%
<b>Общо:</b>	<b>638 405</b>	<b>761 117</b>	<b>937 949</b>	<b>100.00%</b>

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

Company	31.1.2012			29.2.2012			
	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	5.54	10101.38	1825	5.50	10037.5	1.1%
Сентинел рапид	17777.0253	1.22	21714.64	17777.0253	1.22	21732.41	2.3%
CROATIA OSIGURANJE D.D.	32	1659.54	53105.22	32	1564.87	50075.85	5.3%
JADRANSKO OSIGURANJE D.D.	29	697.11	20216.24	29	697.22	20219.41	2.2%
Privredna Banka Zagreb D.D.	155	121.82	18882.08	155	127.05	19692.54	2.1%
ZAGREBACHKA BANKA D.D.	425	10.21	4340.41	425	10.85	4612.68	0.5%
SIF OLTENIA CRAIOVA	45000	0.54	24426.46	80000	0.64	50984.91	5.4%
SIF MOLDOVA BACAU	80000	0.59	47388.92	45000	0.64	28638.53	3.1%
Agrobanka a.d. Beograd	121	27.99	3387.1	121	32.91	3981.96	0.4%
AIK banka a.d. Niš	1236	32.99	40775.58	1236	34.33	42430.41	4.5%
Dunav Osigurianje A.D.	258	18.44	4757.63	258	17.75	4579.54	0.5%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD				950	31.95	30352.78	3.2%
Metals Banka AD Novi Sad	105	11.86	1245.01	105	17.55	1843.27	0.2%
T. Garanti Bankasi	10500	5.55	58272.53	10500	5.47	57448.88	6.1%
İŞ BANKASI (C)	8400	3.19	26830.01	8400	3.39	28444.2	3.0%
Haci Omer Sabanci Holding	7000	5.62	39317.82	7000	6.21	43436.96	4.6%
Türkiye Halk Bankasia A.S.	2100	9.98	20949.94	2100	10.01	21017.88	2.2%

Erste Bank AG	750	31.91	23932.02	750	35.31	26484.38	2.8%
Raiffeisen International Bank-Hold. AG	681	49.36	33611.01	681	52.23	35568.93	3.8%
NBG	1200	4.69	5632.79	1200	4.38	5257.27	0.6%
Piraeus Bank S.A.	3471	1.05	3652.31	3471	0.85	2959.87	0.3%
BANCO BILBAO VISCAYA ARGENTARIA	2700	13.17	35571.07	2700	13.20	35645	3.8%
BANCO SANTANDER SA ORD	2500	11.70	29259.22	2500	12.26	30652.75	3.3%
Intesa Sanpaolo				12000	2.88	34617.25	3.7%
SHS UNICREDIT SPA ORD REG	2200	7.05	15505.75	4400	7.48	32918.51	3.5%
BNP Paribas				450	71.61	32225.72	3.4%
Total:			542875			675859	72.1%

### 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:**  
09.3.2012 г.

**Съставил:**

Иван Иванов: