

ИНФОРМАЦИЯ

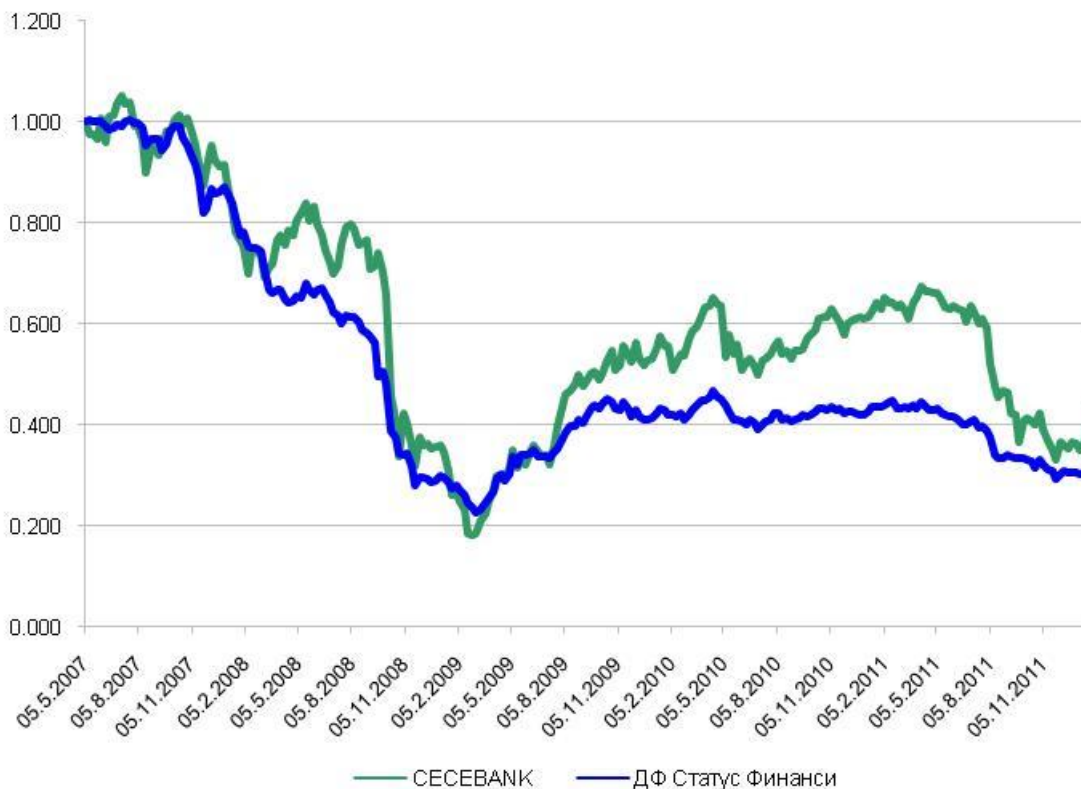
СЪГЛАСНО ИЗИСКВАНИЯТА НА ЧЛ. 72, АЛ. 2 ОТ НАРЕДБА № 44,

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

ЗА ПЕРИОДА от 01.1.2012 г. до 31.1.2012 г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на месец януари нетните активи на Статус Финанси са 758 087.41 лв., което представлява увеличение с 121 912.90 лв. спрямо края на месец декември. Броят на емитираните дялове се увеличава с 155 740.8571 и достига 2 254 152.8635 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 януари се достигна до известно възвръщане на оптимизма на финансовите пазари. След значителното нарастване на възприетия риск през последните месеци, намесата на ЕЦБ за осигуряване на на практика неограничена ликвидност на банките от еврозоната донякъде успокои ситуацията. Очакванията са, че значителна част от тези почти 490 милиарда евро банките ще закупват държавни ценни книжа на държавите от еврозоната. По този начин ЕЦБ избягва прякото си действие като кредитор от последна инстанция на правителства, решение което използваха САЩ и Великобритания, но е кредитор от последна инстанция на банките. И в крайна сметка тези пари ще достигнат и до правителствата по един или друг начин. Въпреки тези очаквания, до момента, в който дълговите пазари на Италия и Испания не се върнат в нормалните си траектории, не би могло да се говори за решение на кризата в Европа. Действията на ЕЦБ, заедно със заявената решимост на европейските лидери да реформират механизмите за бюджетен контрол в Еврозоната, дават основателни причини да смятаме, че най-острата част от кризата в Еврозоната е преминала. Първи доказателства за това дават пазарите на държавни облигации, като италианските десет годишни облигации паднаха от над 7% до под 6% доходност. Увеличението на капитала на Уникредит през януари мина успешно и банката успя почти да удвои капитализацията си спрямо дъното в началото на месеца. За момента основните въпросителни са три - остава несигурна съдбата на Гърция, като яснота по въпроса ще се получи до края на март, когато Гърция трябва да плати част от

облигациите си. Другите две са дали ЕС ще изпадне в рецесия и по какъв начин отделните банки ще решат проблема с отговора на новите изисквания за капиталова адекватност.

През месеца увеличихме експозицията към банки от еврозоната, като закупихме акции на Уникредит. Смятаме, че към момента сигналите за преодоляване на възможната само преди месец катастрофа, са вече достатъчно силни и съотношението риск доходност на европейските банки е достатъчно привлекателно за постепенно увеличение на рисковата ни експозиция към еврозоната.

Изменение	Q2 2010	Q3 2010	Q4 2010	Q1 2011	Q2 2011	Q3 2011	Q4 2011	Януари 2012
ДФ Статус Финанси	-11.26%	5.9%	0.05%	0.7%	-7.5%	-17.2%	-8.7%	10.92%
CECE Banking Financial Index	-18.74%	16.8%	5.7%	2.96%	-2.45%	-34.9%	-11.05%	19.01%

Стандартно отклонение

	Стандартно отклонение
ДФ Статус Финанси	18.35%
CECE Banking Financial Index	35.9%

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

Активи	30.11.2011	31.12.2011	31.1.2012	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	555 203	477 453	542 875	71.33%
Облигации	-	-	-	-
Парични средства	15 381	39 043	95 210	12.51%
Депозити до 3 мес.	119 220	119 220	122 152	16.05%
Вземания	675	2 688	583	0.08%
Други	186	0	297	0.04%
Общо:	690 665	638 405	761 117	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “Статус Финанси” акции

Company	31.12.2011			31.1.2012			
	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	5.65	10311.25	1825	5.54	10101.38	1.3%
Сентинел рапид	17777.0253	1.22	21682.64	17777.0253	1.22	21714.64	2.9%
CROATIA OSIGURANJE D.D.	32	1037.99	33215.62	32	1659.54	53105.22	7.0%
JADRANSKO OSIGURANJE D.D.	59	700.64	41338.03	29	697.11	20216.24	2.7%
Privredna Banka Zagreb D.D.	155	123.26	19105.47	155	121.82	18882.08	2.5%
ZAGREBACHKA BANKA D.D.	425	10.53	4475.42	425	10.21	4340.41	0.6%
SIF OLTENIA CRAIOVA	45000	0.48	21518.07	45000	0.54	24426.46	3.2%
SIF MOLDOVA BACAU	80000	0.49	39086.76	80000	0.59	47388.92	6.2%
Agrobanka a.d. Beograd	121	56.05	6782.53	121	27.99	3387.1	0.4%
AIK banka a.d. Niš	1236	30.80	38071.97	1236	32.99	40775.58	5.4%
Dunav Osigurianje A.D.	258	18.24	4706.51	258	18.44	4757.63	0.6%
Metals Banka AD Novi Sad	105	21.49	2256.92	105	11.86	1245.01	0.2%
T. Garanti Bankasi	10500	4.72	49592.21	10500	5.55	58272.53	7.7%
İŞ BANKASI (C)	8400	2.65	22257.66	8400	3.19	26830.01	3.5%
Haci Omer Sabanci Holding	7000	4.32	30259.66	7000	5.62	39317.82	5.2%
Türkiye Halk Bankasia A.S.	2100	7.93	16642.81	2100	9.98	20949.94	2.8%
Erste Bank AG	750	26.57	19927.46	750	31.91	23932.02	3.1%

Raiffeisen International Bank-Hold. AG	681	39.24	26724.98	681	49.36	33611.01	4.4%
NBG	1200	3.17	3802.13	1200	4.69	5632.79	0.7%
Piraeus Bank S.A.	3471	0.49	1717.54	3471	1.05	3652.31	0.5%
BANCO BILBAO VISCAYA ARGENTARIA	2700	13.06	35275.35	2700	13.17	35571.07	4.7%
BANCO SANTANDER SA ORD	2500	11.48	28701.81	2500	11.70	29259.22	3.8%
SHS UNICREDIT SPA ORD REG				2200	7.05	15505.75	2.0%
Total:			477453			542875	71.3%

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:
10.2.2012 г.

Съставил:

Иван Иванов: