

ИНФОРМАЦИЯ

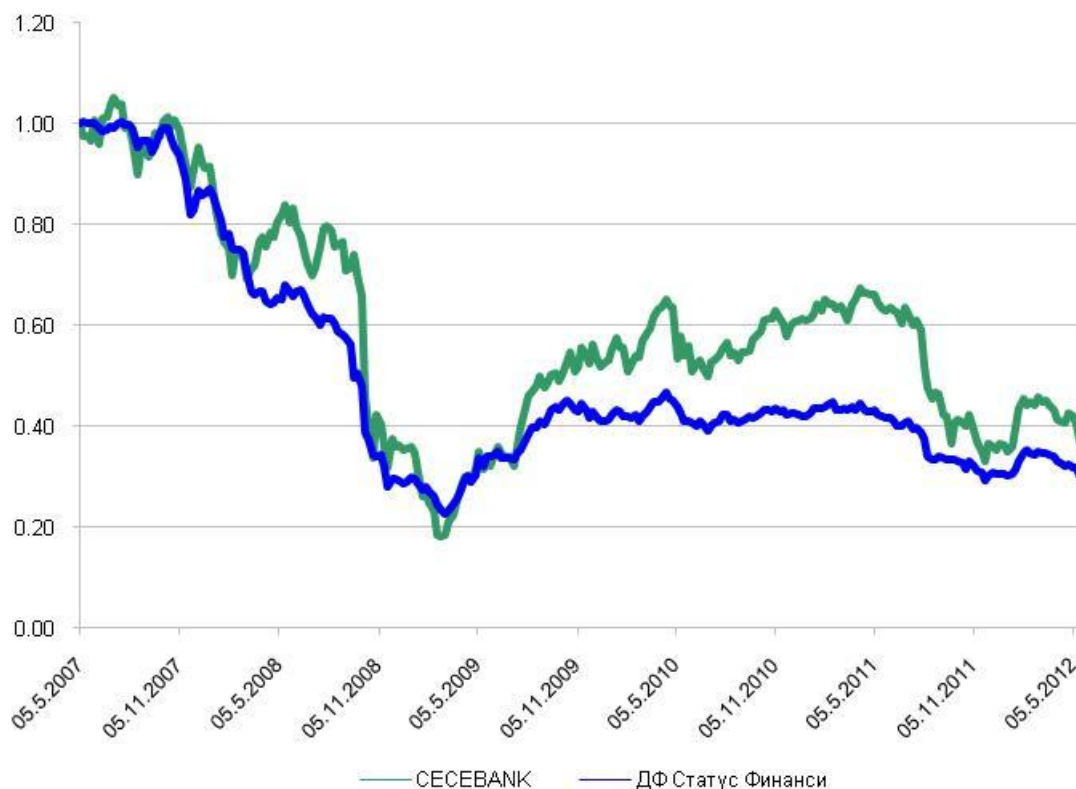
СЪГЛАСНО ИЗИСКВАНИЯТА НА ЧЛ. 72, АЛ. 2 ОТ НАРЕДБА № 44,

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

ЗА ПЕРИОДА от 01.5.2012 г. до 31.5.2012 г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на месец май нетните активи на Статус Финанси са 901 624.35 лв., което представлява намаление с -65 576.05 лв. спрямо края на месец април. Броят на емитираните дялове намалява с -1 501.0674 и достига 3 007 018.9901 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 месец май рисковете пред европейската икономика продължиха да оказват натиск върху пазарите. Европейската икономика все по-ясно навлиза във втора рецесия, плод на дълговата криза от есента на миналата година. Макар че очакванията са тази рецесия да продължи само две тримесечия, и растежът в Европа да се върне през второто тримесечие на 2012, самият факт на спадащ БВП, създава несигурност в Европа. Големите развиващи се пазари като Китай и Индия също показват признаци за охлаждане, като така и последния двигател на икономическия растеж в световен план намалява влиянието си. Нуждата от спасяване на Банкия, третата по-големина банка в Испания, в съчетание с неясната политическа ситуация в Гърция и несигурността как ще се отрази евентуално излизане на страна от Еврозоната повишиха рисковите премии в Европа. Ситуацията напомни за кризисните моменти от декември миналата година преди ЕЦБ да налее ликвидност във финансовата система. Банките в Еврозоната макар и да повишиха значително ликвидността си, все още остава да се сблъскат с доста предизвикателства през оставащите месеци. Една значителна част от тях трябва да си увеличат капитала, за да отговорят на новите изисквания за капиталова адекватност. Като това се отнася с особена тежест за Испания, където пазарите имат сериозни съмнения че банките не са провизирали достатъчно лоши кредити, раздадени покрай строителния бум.

Проблемите, които трябва да реши Европа през следващите месеци, са капитализация на испанските банки и как точно смята да стимулира растежа в зоната, защото вече е очевидно, че едностранчивото поставяне на бюджетната дисциплина и намаляване на дълговете на първо място дава доста противоречиви резултати. Голямата въпросителна е и бъдещето на Гърция в еврозоната и евентуално пренасяне на паника и сред други членки, ако Гърция излезе.

Двете испански банки, в които има акции ДФ Статус Финанси, са глобални по-същество. По-голямата част от печалбите им идват извън Испания. Към момента и Сантандер и ББВА, са отлично капитализирани и вероятността да поискат помощ е изключително ниска.

Изменение	Q4 2010	Q1 2011	Q2 2011	Q3 2011	Q4 2011	Q1 2012	Април 2012	Май 2012
ДФ Статус Финанси	0.05%	0.7%	-7.5%	-17.2%	-8.7%	11.87%	-5.22%	-6.75%
CECE Banking Financial Index	5.7%	2.96%	-2.45%	-34.9%	-11.05%	19.3%	-1.49%	-14.2%

Стандартно отклонение

	Стандартно отклонение
ДФ Статус Финанси	19.19%
CECE Banking Financial Index	36.96%

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

Активи	31.3.2012	30.4.2012	31.5.2012	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	704 164	679 068	609 728	67.41%
Облигации	-	-	-	-
Парични средства	194 613	155 441	156 427	17.29%
Депозити до 3 мес.	122 152	123 679	123 679	13.67%
Вземания	2 218	10 764	13 672	1.51%
Други	1 406	1 228	1 044	0.12%
Общо:	1 024 554	970 180	904 550	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “Статус Финанси” акции

Company	30.4.2012			31.5.2012			
	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	6.00	10946.35	1825	5.75	10493.75	1.2%
Сентинел рапид	17777.0253	1.23	21782.19	17777.0253	1.23	21826.63	2.4%
CROATIA OSIGURANJE D.D.	32	1600.48	51215.23	32	1566.12	50115.68	5.5%
JADRANSKO OSIGURANJE D.D.	29	707.88	20528.56	29	737.24	21379.93	2.4%
Privredna Banka Zagreb D.D.	155	142.87	22145.12	155	135.90	21064.9	2.3%
ZAGREBACHKA BANKA D.D.	425	11.04	4692.84	425	9.71	4125.61	0.5%
SIF OLTENIA CRAIOVA	80000	0.51	40437.8	80000	0.45	36144.02	4.0%
SIF MOLDOVA BACAU	45000	0.63	28182.1	45000	0.46	20488.62	2.3%
Agrobanka a.d. Beograd	121	16.60	2009.17	121	0.00	0.01	0.0%
AIK banka a.d. Niš	1236	27.97	34565.82	1236	23.51	29063.91	3.2%
Dunav Osigurianje A.D.	258	17.44	4500.48	258	16.65	4296.91	0.5%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	950	28.14	26733.63	950	27.00	25652.93	2.8%
Metals Banka AD Novi Sad	105	19.80	2079.35	105	16.74	1757.55	0.2%
T. Garanti Bankasi	10500	5.43	56986.22	10500	5.07	53198.93	5.9%

İŞ BANKASI (C)	8400	3.38	28369.61	8400	3.27	27441.33	3.0%
Haci Omer Sabanci Holding	7000	6.13	42930.8	7000	6.02	42153.13	4.7%
Turkiye Halk Bankasia A.S.	2100	10.33	21700.64	2100	9.85	20688.47	2.3%
Erste Bank AG	1330	34.02	45248.81	1330	27.47	36534.61	4.0%
Raiffeisen International Bank-Hold. AG	981	49.06	48129.82	981	44.01	43170.06	4.8%
NBG	1200	3.29	3942.95	1200	2.27	2722.52	0.3%
Piraeus Bank S.A.	3471	0.51	1765.06	3471	0.42	1445.99	0.2%
BANCO BILBAO VISCAYA ARGENTARIA	2700	9.99	26963.46	2500	8.31	20780.69	2.3%
BANCO SANTANDER SA ORD	2500	9.23	23078.79	2700	8.94	24143.55	2.7%
Intesa Sanpaolo	12000	2.27	27268.1	12000	1.97	23643.87	2.6%
SHS UNICREDIT SPA ORD REG	9400	5.97	56153.62	9400	4.83	45430.5	5.0%
				450	0.00	0.01	0.0%
BNP Paribas	450	59.36	26711.75	450	48.81	21963.48	2.4%
Total:			679068			609728	67.4%

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:

08.6.2012 г.

Съставил:

Иван Иванов: