

ИНФОРМАЦИЯ

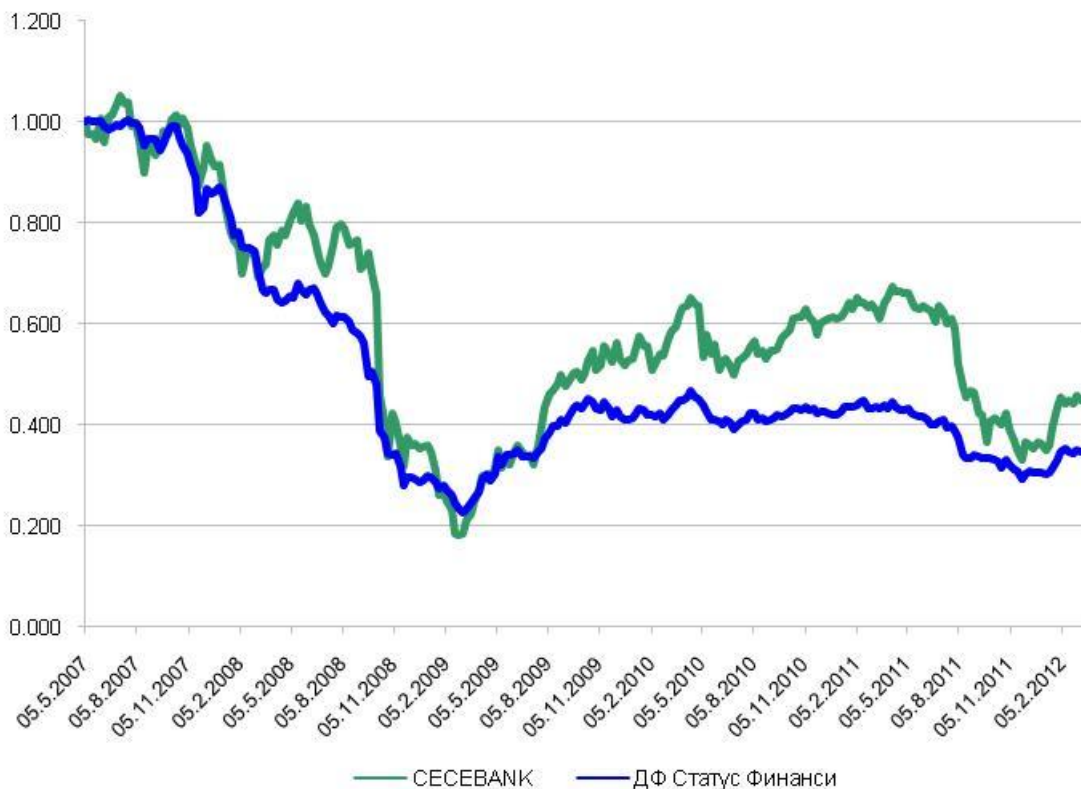
СЪГЛАСНО ИЗИСКВАНИЯТА НА ЧЛ. 72, АЛ. 2 ОТ НАРЕДБА № 44,

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

ЗА ПЕРИОДА от 01.3.2012 г. до 31.3.2012 г.

Направени промени в структурата на портфейла и обосновка за тях

Към края на месец март нетните активи на Статус Финанси са 1 020 695.52 лв., което представлява увеличение с 87 463.49 лв. спрямо края на месец февруари. Броят на емитираните дялове се увеличава с 289 615.6476 и достига 3 008 993.2194 бр.



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

Оптимизмът на борсите от началото на годината започна малко по-малко да се изчерпва през март. Действията на ЕЦБ по вкарване на ликвидност успяха да намалят възприемания риск, но до колко и кога ще въздействат и за постигане на растеж на европейската икономика все още е неясно. 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. В същото време и от други части на света се получават противоречиви сигнали. В САЩ растежите на БВП вече се отразяват и на заетостта, която нараства със силни темпове няколко месеца под ред, като успя да пречупи тенденцията за увеличаваща се безработица. В другия двигател на световната икономика – Китай в същото време очакванията за забяване на темповете на растеж стават все по-силни, като официално управляващите държавата вече смъкнаха таргетируания растеж до 7,5% годишно. 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.

Подобно разнородно съчетание на новини и очаквания от една страна неизбежно води до смекчаване както на крайно позитивните, но така също и на негативните очаквания към

движението на капиталовите пазари. Напълно възможно е в следващите седмици или дори месеци да станем свидетели на известна консолидация на пазарите.

През месец март повишихме експозицията си към Уникредит, с което банките от еврозоната достигнаха 25% от активите. При последваща консолидация, смятаме да увеличим допълнително експозицията си към тях. В същото време продължаваме да следваме относително консервативна политика, с дял на акциите около и под 70% от активите.

Изменение	Q3 2010	Q4 2010	Q1 2011	Q2 2011	Q3 2011	Q4 2011	Q1 2012	Март 2012
ДФ Статус Финанси	5.9%	0.05%	0.7%	-7.5%	-17.2%	-8.7%	11.87%	-1.17%
CECE Banking Financial Index	16.8%	5.7%	2.96%	-2.45%	-34.9%	-11.05%	19.3%	-4.15%

Стандартно отклонение

	Стандартно отклонение
ДФ Статус Финанси	18.79%
CECE Banking Financial Index	35.84%

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

Активи	31.1.2012	29.2.2012	31.3.2012	Структура на активите спрямо общата им стойност /%/
Акции и права	542 875	675 859	704 164	68.73%
Облигации	-	-	-	-
Парични средства	95 210	139 188	194 613	18.99%
Депозити до 3 мес.	122 152	122 152	122 152	11.92%
Вземания	583	498	2 218	0.22%
Други	297	251	1 406	0.14%
Общо:	761 117	937 949	1 024 554	100.00%

Стойност на притежаваните от ДФ “Статус Финанси” акции

Company	29.2.2012			31.3.2012			
	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	5.50	10037.5	1825	5.80	10585	1.0%
Сентинел рапид	17777.0253	1.22	21732.41	17777.0253	1.22	21750.19	2.1%
CROATIA OSIGURANJE D.D.	32	1564.87	50075.85	32	1563.63	50036.01	4.9%
JADRANSKO OSIGURANJE D.D.	29	697.22	20219.41	29	858.35	24892.18	2.4%
Privredna Banka Zagreb D.D.	155	127.05	19692.54	155	139.28	21588.94	2.1%
ZAGREBACHKA BANKA D.D.	425	10.85	4612.68	425	11.84	5032.17	0.5%
SIF OLTENIA CRAIOVA	80000	0.64	50984.91	80000	0.58	46597.17	4.5%
SIF MOLDOVA BACAU	45000	0.64	28638.53	45000	0.62	28118.98	2.7%
Agrobanka a.d. Beograd	121	32.91	3981.96	121	25.47	3081.33	0.3%
AIK banka a.d. Niš	1236	34.33	42430.41	1236	31.84	39355.13	3.8%
Dunav Osigurianje A.D.	258	17.75	4579.54	258	16.33	4213.93	0.4%
KOMERCIJALNA BANKA AD BEOGRAD	950	31.95	30352.78	950	31.61	30031.79	2.9%
Metals Banka AD Novi Sad	105	17.55	1843.27	105	19.78	2076.41	0.2%
T. Garanti Bankasi	10500	5.47	57448.88	10500	5.81	60984.97	6.0%
İŞ BANKASI (C)	8400	3.39	28444.2	8400	3.61	30337	3.0%
Haci Omer Sabanci Holding	7000	6.21	43436.96	7000	6.30	44111.89	4.3%

Turkiye Halk Bankasia A.S.	2100	10.01	21017.88	2100	10.49	22027.15	2.1%
Erste Bank AG	750	35.31	26484.38	750	33.82	25362.23	2.5%
Raiffeisen International Bank-Hold. AG	681	52.23	35568.93	681	51.83	35295.89	3.4%
NBG	1200	4.38	5257.27	1200	3.76	4506.23	0.4%
Piraeus Bank S.A.	3471	0.85	2959.87	3471	0.57	1989.08	0.2%
BANCO BILBAO VISCAYA ARGENTARIA	2700	13.20	35645	2700	11.67	31510.18	3.1%
BANCO SANTANDER SA ORD	2500	12.26	30652.75	2500	11.29	28212.85	2.8%
Intesa Sanpaolo	12000	2.88	34617.25	12000	2.63	31552.78	3.1%
SHS UNICREDIT SPA ORD REG	4400	7.48	32918.51	9400	7.40	69604.49	6.8%
BNP Paribas	450	71.61	32225.72	450	69.58	31310.39	3.1%
Total:			675859			704164	68.7%

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:

10.4.2012 г.

Съставил:

Иван Иванов: