

FIMA VRIJEDNOSNICE d.o.o. VARAŽDIN

Izvešća o adekvatnosti kapitala investicijskog društva

Obrazac o izračunima kapitala i kapitalnih zahtjeva za rizike
kojima je investicijsko društvo izloženo za mjesec prosinac 2009.

Obrazac K: Kapital

| |
|---|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: K: Kapital |
| Datum: 31.12.2009. |

| Oznaka pozicije | STAVKA | IZNOS (u tisućama kuna) |
|-----------------|--|----------------------------|
| 1. | KAPITAL | 6.585 |
| 1.1. | Izračun osnovnog kapitala | |
| 1.1.1. | Uplaćene redovne dionice | |
| 1.1.2. | Uplaćene nekumulativne povlaštene dionice | |
| 1.1.3. | Uplaćeni poslovni udjeli | 6.300 |
| 1.1.4. | Rezerve formirane iz dobiti nakon oporezivanja | |
| 1.1.4.1. | zakonske | |
| 1.1.4.2. | statutarne | |
| 1.1.4.3. | za otkup vlastitih dionica | |
| 1.1.4.4. | ostale rezerve | |
| 1.1.5. | Rezerve kapitala (redovnih i nekumulativnih povlaštenih dionica) | |
| 1.1.6. | Zadržana dobit | 990 |
| 1.1.7. | Dobit tekuće godine | |
| 1.1.7.1. | na osnovu godišnjeg financijskog izvještaja | |
| 1.1.7.2. | na osnovu financijskih izvještaja za razdoblja tijekom godine | |
| 1.1.8. | Zbroj stavki (1.1.1 do 1.1.7) | 7.290 |
| 1.1.9. | Stečene vlastite dionice | |
| 1.1.9.1. | redovne dionice | |
| 1.1.9.2. | nekumulativne povlaštene dionice | |
| 1.1.10. | Nematerijalna imovina | |
| 1.1.11. | Zadržani gubici | |
| 1.1.12. | Gubitak tekuće godine | -1.859 |
| 1.1.12.1. | na osnovu godišnjeg financijskog izvještaja | -1.859 |
| 1.1.12.2. | na osnovu financijskih izvještaja za razdoblja tijekom godine | 0 |
| 1.1.13. | Rezerve kapitala (redovnih i nekumulativnih povlaštenih dionica) | 0 |
| 1.1.14. | Zbroj stavki (1.1.9. do 1.1.13.) | -1.859 |
| 1.1.15. | Manjinski interesi | 0 |
| 1.1.16. | Negativne konsolidirane rezerve | 0 |
| 1.1.17. | Pozitivne konsolidirane rezerve | 0 |
| 1.1.18. | Zbroj stavki (1.1.15. do 1.1.17.) | 0 |
| A. | OSNOVNI KAPITAL | 5.431 |
| 1.2. | Izračun dopunskog kapitala I | |
| 1.2.1. | Posebne rezerve | 2.346 |
| 1.2.1.1. | dugotrajne materijalne imovine | 1.407 |
| 1.2.1.2. | dugotrajne financijske imovine | 939 |
| 1.2.1.3. | efekt primjene metode zamjenske vrijednosti | 0 |
| 1.2.1.4. | efekt vrednovanja u uvjetima inflacije | 0 |
| 1.2.2. | Kumulativne povlaštene dionice s pripadnim rezervama kapitala | 0 |
| 1.2.2.1. | neodređenog dospjeća | 0 |
| 1.2.2.2. | fiksnog dospjeća | 0 |
| 1.2.3. | Podređeni instrumenti | 0 |
| 1.2.4. | Vrijednosni papiri i drugi instrumenti neodređenog roka dospjeća | 0 |
| 1.2.5. | Instrumenti slični podređenima | 0 |
| 1.2.6. | Podređeni instrumenti iznad ograničenja | 0 |
| 1.2.7. | Zbroj stavki dopunskog kapitala I (1.2.1. do 1.2.6.) | 2.346 |
| 1.2.8. | Dopunski kapital I iznad ograničenja | 0 |
| B. | DOPUNSKI KAPITAL I | 2.346 |

| | | |
|---------------|---|---------------|
| 1.3. | Izračun dopunskog kapitala II | |
| 1.3.1. | Podređeni instrumenti koji nisu uključeni u dopunski kapital I | 0 |
| 1.3.2. | Vrijednosni papiri i drugi instrumenti neodređenog roka dospjeća koji nisu uključeni u dopunski kapital I | 0 |
| 1.3.3. | Instrumenti slični podređenima koji nisu uključeni u dopunski kapital I | 0 |
| 1.3.4. | Neto dobit iz knjige trgovanja | 0 |
| 1.3.5. | Pozitivni iznos izračuna kreditnim rizikom ponderiranih izloženosti prema IRB pristupu | 0 |
| 1.3.6. | Zbroj stavki dopunskog kapitala II (1.3.1. do 1.3.5.) | 0 |
| 1.3.7. | Neiskorišteni dopunski kapital II | 0 |
| 1.3.8. | Dopunski kapital II iznad ograničenja | 0 |
| C. | DOPUNSKI KAPITAL II | 0 |
| 1.4. | Odbitne stavke kapitala | |
| 1.4.1. | Udjeli u drugim investicijskim društvima i drugim pravnim osobama*, koji prelaze 10% njihovog kapitala | -1.082 |
| 1.4.2. | Ulaganja u instrumente (iz članka 158. stavka 2. ZTK) drugih investicijskih društava i drugih pravnih osoba* u kojima ID ima ulaganja veća od 10% kapitala | |
| 1.4.3. | Udjeli u drugim investicijskim društvima i drugim pravnim osobama* (koji nisu obuhvaćeni u poziciji 1.4.1 i 1.4.2) koji ne prelaze 10% njihova kapitala i ulaganja u instrumente (iz članka 158. stavka 2. ZTK) tih pravnih osoba, kad zajedno prelaze 10% kapitala | -111 |
| 1.4.4. | Udjeli u društvima za osiguranje, reosiguranje i koncernima osiguravatelja i ulaganja u instrumente tih pravnih osoba | |
| 1.4.5. | Negativni iznos izračuna kreditnim rizikom ponderiranih izloženosti i iznos očekivanog gubitka koji proizlaze iz izračuna kapitalnih zahtjeva za kreditni rizik primjenom IRB pristupa | |
| 1.4.6. | Prenesena vrijednost uvećana za trenutni iznos pozitivne izloženosti u slučaju slobodne isporuke, pri izračunu kapitalnih zahtjeva za rizik namire | |
| 1.4.7. | Zbroj stavki (od 1.4.1 do 1.4.6) | -1.192 |
| 1.4.8. | Odbitne stavke na teret osnovnog kapitala | -596 |
| 1.4.8.1. | 50% ukupnog iznosa odbitnih stavki kapitala | -596 |
| 1.4.8.2. | višak iznad 50% ukupnog iznosa odbitnih stavki koji tereti dopunski kapital I | 0 |
| 1.4.9. | Odbitne stavke na teret dopunskog kapitala I | -596 |
| 1.4.9.1. | 50% ukupnog iznosa odbitnih stavki kapitala | -596 |
| D. | ODBITNE STAVKE KAPITALA | -1.192 |
| 1.5. | Nelikvidna sredstva | |
| 1.5.1. | dugotrajna materijalna imovina, osim zemljišta i zgrada koji se mogu saldirati s iznosima kredita za koje služe kao osiguranje | |
| 1.5.2. | udjeli investicijskog društva i ulaganja u podređene instrumente drugih investicijskih društava i drugih pravnih osoba*, koji mogu biti uključeni u kapital tih subjekata, a nisu odbijeni od kapitala | |
| 1.5.3. | teže utrživi udjeli ili drugi oblici ulaganja u nefinancijske institucije | |
| 1.5.4. | gubici u ovisnim društvima | |
| 1.5.5. | depoziti, osim onih koji su raspoloživi za isplatu u roku od 90 dana i svih plaćanja vezanih za futures ugovore ili opcije | |
| 1.5.6. | kreditni ili drugi dospjeli iznosi, osim onih koji moraju biti otplaćeni u roku od 90 dana | |
| 1.5.7. | robne zalihe | |
| E. | NELIKVIDNA SREDSTVA | |

| | | |
|-------------|---|--------------|
| 1.6. | Dodatne informacije | |
| 1.6.1. | skupštinske odluke (izglasana dividenda tekuće godine) | |
| 1.6.2. | skupštinske odluke (isplaćene dividende tekuće godine) | |
| 1.6.3. | rezerve kapitala ostvarene emisijom dionica | |
| 1.6.4. | dobit prethodne godine (rezerve za vlastite dionice) | |
| 1.6.5. | neuključena dobit tekuće godine | |
| 1.6.6. | nerealizirani gubitak s osnova vrijednosnog usklađenja financijske imovine raspoložive za prodaju | |
| 1.6.7. | ispravci vrijednosti i rezervacije prema IRB pristupu | |
| 1.6.7.1. | od toga: na pojedinačnoj osnovi | |
| 1.6.7.2. | od toga: na konsolidiranoj osnovi | |
| 1.6.8. | očekivani gubitak prema IRB pristupu | |
| 1.7. | Minimalni iznos temeljnog kapitala | 6.000 |

Napomena: * pod drugim pravnim osobama podrazumijevaju se druge financijske institucije, kreditne institucije, društva za upravljanje otvorenim investicijskim fondovima s javnom ponudom i društva za pomoćne usluge

Obrazac AK: Adekvatnost kapitala

| |
|---|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: AK: Adekvatnost kapitala |
| Datum: 31.12.2009. |

| Oznaka pozicije | STAVKA | IZNOS (u tisućama kuna) | POKRIVENOST OSNOVNIM KAPITALOM | POKRIVENOST DOPUNSKIM KAPITALOM I | POKRIVENOST DOPUNSKIM KAPITALOM II |
|------------------|--|---|-----------------------------------|--------------------------------------|---------------------------------------|
| 1. | KAPITAL | 6.585 | | | |
| A. | OSNOVNI KAPITAL | 5.431 | | | |
| B. | DOPUNSKI KAPITAL I | 2.346 | | | |
| C. | DOPUNSKI KAPITAL II | 0 | | | |
| 2. | KAPITALNI ZAHTEVI | 2.950 | | | |
| 2.1. | Izračun kapitalnih zahtjeva za kreditni rizik, rizik druge ugovorne strane i rizik slobodnih isporuka | | | | |
| 2.1.1. | Standardizirani pristup | 694 | | | |
| 2.1.1.1a. | Kategorije izloženosti prema standardiziranom pristupu | KRSP obrazac na nivou ukupne izloženosti. (kategorije izloženosti prema standardiziranom pristupu iz članka 126. Pravilnika o adekvatnosti kapitala investicijskih društava) SUMA 2.1.1.1.a.i. i=1 do 14 | | | |
| 2.1.1.1.a.01. | Središnja država ili središnje banke | 0 | | | |
| 2.1.1.1.a.02. | Jedinice regionalne i lokalne samouprave | 0 | | | |
| 2.1.1.1.a.03. | Javna državna tijela | 0 | | | |
| 2.1.1.1.a.04. | Multilateralne razvojne banke | 0 | | | |
| 2.1.1.1.a.05. | Međunarodne organizacije | 0 | | | |
| 2.1.1.1.a.06. | Institucije | 11 | | | |
| 2.1.1.1.a.07. | Trgovačka društva | 465 | | | |
| 2.1.1.1.a.08. | Stanovništvo | 1 | | | |
| 2.1.1.1.a.09. | Osigurane nekretninama | 0 | | | |
| 2.1.1.1.a.10. | Dospjela nenaplaćena potraživanja | 4 | | | |
| 2.1.1.1.a.11. | Visokorizična potraživanja | 0 | | | |
| 2.1.1.1.a.12. | Pokrivene obveznice | 0 | | | |
| 2.1.1.1.a.13. | Kratkoročna potraživanja od institucija i trgovačkih društava | 19 | | | |
| 2.1.1.1.a.14. | Potraživanja u obliku ulaganja u subjekte za zajednička ulaganja | 0 | | | |
| 2.1.1.1.a.15. | Ostale izloženosti | 194 | | | |
| F. | KAPITALNI ZAHTEV ZA KREDITNI RIZIK, RIZIK DRUGE UGOVORNE STRANE I RIZIK SLOBODNE ISPORUKE | 694 | 694 | 0 | |
| 2.2 | Izračun kapitalnog zahtjeva za rizik namire | | | | |
| G. | KAPITALNI ZAHTEV ZA RIZIK NAMIRE | 0 | 0 | 0 | |
| 2.3. | Izračun kapitalnih zahtjeva za pozicijski rizik, valutni rizik i robni rizik | | 0 | | |
| 2.3.1. | Pozicijski rizik, valutni rizik i robni rizik izračunati prema standardiziranim pristupima | 67 | 67 | 0 | 0 |
| 2.3.1.1. | Specifični rizik dužničkih financijskih instrumenata | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.3.1.2. | Opći rizik dužničkih financijskih instrumenata (pristup temeljen na dospjeću) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.3.1.3. | Opći rizik dužničkih financijskih instrumenata (pristup temeljen na trajanju) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.3.1.4. | Specifični i opći pozicijski rizik jedinica u subjektima za zajednička ulaganja | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.3.1.5. | Rizik pozicije u opcijama | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.3.1.6. | Specifični i opći pozicijski rizik vlasničkih financijskih instrumenata | 25 | 25 | 0 | 0 |
| 2.3.1.7. | Valutni rizik | 42 | 42 | 0 | 0 |
| 2.3.1.8. | Robni rizik (jednostavni pristup) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.3.1.9. | Robni rizik (pristup ljestvice dospjeća) | 0 | 0 | 0 | 0 |

| | | | | | |
|-------------|--|--------------|--------------|----------|----------|
| 2.3.1.10. | Rizik prekoračenja dopuštenih izloženosti | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.3.2. | Pozicijski rizik, valutni rizik i/ili robni rizik izračunati primjenom internih modela | 0 | 0 | 0 | 0 |
| H. | KAPITALNI ZAHTEJEV ZA POZICIJSKI RIZIK, VALUTNI RIZIK I ROJNI RIZIK | 67 | 67 | 0 | 0 |
| 2.4. | Izračun kapitalnog zahtjeva za operativni rizik | | | | |
| 2.4.1. | Jednostavni pristup | 2.189 | 2.189 | 0 | |
| 2.4.2. | Standardizirani pristup | 0 | 0 | 0 | |
| 2.4.3. | Napredni pristup | 0 | 0 | 0 | |
| I. | KAPITALNI ZAHTEJEV ZA OPERATIVNI RIZIK | 2.189 | 2.189 | 0 | |
| 2.5. | Izračun kapitalnog zahtjeva prema članku 177. ZTK (1/4 općih troškova iz prethodne poslovne godine) | | | | |
| J. | KAPITALNI ZAHTEJEV PREMA ČLANKU 177. ZTK (1/4 OPĆIH TROŠKOVA IZ PRETHODNE POSLOVNE GODINE) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2.7. | ZAKLJUČNE BILJEŠKE | | | | |
| 2.7.1. | Višak (+)/manjak (-) kapitala nakon pokriva kapitalnih zahtjeva izuzimajući druge kapitalne zahtjeve | 3.634 | | | |
| 2.7.1.a. | Adekvatnost kapitala izuzimajući kapitalni zahtjev za rizik prekoračenja dopuštenih izloženosti | 2,23 | | | |
| 2.8. | Višak (+)/manjak (-) kapitala | 585 | | | |
| 2.8.a. | Adekvatnost kapitala | 2,23 | | | |
| 2.9. | Višak (+)/manjak (-) kapitala uzevši u obzir nadzorne mjere | N/A | | | |
| 2.9.a. | Adekvatnost kapitala uzevši u obzir nadzorne mjere | N/A | | | |
| 2.10. | Višak (+)/manjak (-) internog kapitala | | | | |
| 2.10.1. | Interna ocjena kapitala | | | | |
| 2.10.2. | Interna ocjena kapitalnih zahtjeva | | | | |

Datum: 31.12.2009.

Sastavio:

Željko Bunjevac, Risk manager

Telefonski broj: 01 6398 356

Žig i potpis odgovorne osobe:

Neven Kaić, Predsjednik Uprave

Obrazac KONS: Adekvatnost kapitala na konsolidiranoj osnovi za grupu investicijskog društva u RH

(u tisućama kuna)

| GRUPA INVESTICIJSKOG DRUŠTVA U RH | | | | | | | KAPITAL | | VIŠAK (+)/MANJAK(-) KAPITALA | VIŠAK (+)/MANJAK(-) KAPITALA UZEVIŠI U OBZIR NADZORNE MJERE |
|-----------------------------------|--------------|--|---|---|---|--|-----------------------|-----------------------------|---------------------------------|--|
| NAZIV DRUŠTVA | MATIČNI BROJ | KAPITALNI ZAHTJEVI ZA KREDITNI RIZIK, RIZIK DRUGE UGOVORNE STRANE I RIZIK SLOBODNE ISPORUKE | KAPITALNI ZAHTJEV ZA RIZIK NAMIRE | KAPITALNI ZAHTJEVI ZA POZICIJSKI RIZIK, VALUTNI RIZIK I ROBNI RIZIK | KAPITALNI ZAHTJEV ZA OPERATIVNI RIZIK | KAPITALNI ZAHTJEV ZA RIZIK PREKORAČENJA DOPUŠTENIH IZLOŽENOSTI | KAPITALNI ZAHTJEVI | OD ČEGA: OSNOVNI KAPITAL | 11=9-8 | 12 |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 10 | | |
| | | | | | | | | | | |

Datum: 31.12.2009.

Sastavio:

Žig i potpis odgovorne osobe:

Željko Bunjevac, Risk manager

Neven Kaić, Predsjednik Uprave

Obrazac KT: Knjiga trgovanja - dnevna stanja

| |
|--|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.C |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Datum: 31.12.2009. |

(u tisućama kuna)

| Redni broj | Datum/Radni dan | Ukupna tržišna vrijednost stavaka u knjizi trgovanja |
|------------|-----------------|--|
| 1 | 2 | 3 |
| 1 | 1.12.2009 | 213,74 |
| 2 | 2.12.2009 | 224,36 |
| 3 | 3.12.2009 | 219,82 |
| 4 | 4.12.2009 | 217,39 |
| 5 | 7.12.2009 | 203,88 |
| 6 | 8.12.2009 | 246,92 |
| 7 | 9.12.2009 | 248,58 |
| 8 | 10.12.2009 | 198,51 |
| 9 | 11.12.2009 | 200,34 |
| 10 | 14.12.2009 | 195,25 |
| 11 | 15.12.2009 | 191,13 |
| 12 | 16.12.2009 | 192,05 |
| 13 | 17.12.2009 | 186,21 |
| 14 | 18.12.2009 | 186,35 |
| 15 | 21.12.2009 | 180,92 |
| 16 | 22.12.2009 | 187,96 |
| 17 | 23.12.2009 | 191,50 |
| 18 | 24.12.2009 | 191,34 |
| 19 | 28.12.2009 | 191,05 |
| 20 | 29.12.2009 | 189,92 |
| 21 | 30.12.2009 | 188,72 |
| 22 | 31.12.2009 | 205,66 |

Obrazac DKT: Detaljna knjiga trgovanja

| |
|---|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Datum: 31.12.2009. |

(u tisućama kuna)

| Redni broj | Naziv instrumenta | Oznaka instrumenta/posla | Oznaka valute | Tečaj | Količina | Nominalna vrijednost u valuti | Nominalna vrijednost u kunama | Tržišna vrijednost u valuti | Tržišna vrijednost u kunama |
|---|-------------------|--------------------------|---------------|-------|----------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 |
| 1. Dionice i drugi vrijednosni papiri istog značaja | | | | | | | | | |
| 3 | Redovna dionica | BRIK-R-A | HRK | 1,00 | 12 | 0,30 | 3,60 | 0,10 | 1,26 |
| 4 | Redovna dionica | DLKV-R-A | HRK | 1,00 | 150 | 0,10 | 15,00 | 0,32 | 47,55 |
| 2 | Redovna dionica | IGH-R-A | HRK | 1,00 | 20 | 0,40 | 8,00 | 2,56 | 51,16 |
| 5 | Redovna dionica | INGR-R-A | HRK | 1,00 | 1220 | 0,04 | 48,80 | 0,04 | 48,80 |
| 1 | Redovna dionica | MNDS-R-A | HRK | 1,00 | 28 | 1,87 | 52,36 | 0,25 | 6,89 |
| 6 | Redovna dionica | SLDM-R-A | HRK | 1,00 | 1000 | 0,07 | 70,00 | 0,05 | 50,00 |
| | Ukupno | | | | | | | | 205,66 |
| 2. Dužnički financijski instrumenti | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | Ukupno | | | | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 3. Ostali prenosivi vrijednosni papiri | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | Ukupno | | | | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 4. Instrumenti tržišta novca | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | Ukupno | | | | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 5. Jedinice u subjektima za zajednička ulaganja | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | Ukupno | | | | | | | | 0,00 |
| 6. Financijski futures ugovori | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | Ukupno | | | | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 7. Forward ugovori | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | Ukupno | | | | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 8. Swap ugovori | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | Ukupno | | | | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 9. Opcije | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | Ukupno | | | | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 10. Kreditne izvedenice | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | Ukupno | | | | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 11. Roba - fizički proizvodi | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | Ukupno | | | | 0 | | | 0,00 | 0,00 |
| 12. Robni derivati | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | Ukupno | | | | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 13. Izloženosti proizašle iz nenamirenih transakcija | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | Ukupno | | | | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 14. Izloženosti proizašle iz slobodnih isporuka | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | Ukupno | | | | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 15. Izloženosti proizašle iz repo ugovora i ugovora o posuđivanju vrijednosnih papira ili robe drugoj ugovornoj strani | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | |
| | Ukupno | | | | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

| | | | | | | | | |
|---|--------|--|--|---|------|------|------|------|
| 16. Izloženosti proizašle iz obratnih repo ugovora i ugovora o posuđivanju vrijednosnih papira ili robe od druge ugovorne strane | | | | | | | | |
| | | | | | | | | |
| | | | | | | | | |
| | Ukupno | | | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 17. Izloženosti proizašle iz maržnih transakcija | | | | | | | | |
| | | | | | | | | |
| | | | | | | | | |
| | Ukupno | | | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 18. Izloženosti proizašle iz transakcija s dugim rokom namire | | | | | | | | |
| | | | | | | | | |
| | | | | | | | | |
| | Ukupno | | | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 19. Financijski instrumenti ostvareni na temelju ugovora o provedbi ponude odnosno pradaje financijskih instrumenata uz obvezu otkupa | | | | | | | | |
| | | | | | | | | |
| | | | | | | | | |
| | Ukupno | | | 0 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | | | | | | | | |
| | | | | | | | | |
| | Ukupno | | | | | | | |

Obrazac SR: Specifični rizik dužničkih financijskih instrumenata

| |
|---|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: SR: Specifični rizik dužničkih financijskih instrumenata |
| Datum: 31.12.2009. |

| | |
|---------|--|
| Valuta: | |
|---------|--|

(u tisućama kuna)

| KATEGORIJA | KAPITALNI ZAHTJEV ZA SPECIFIČNI RIZIK | OTVORENA DUGA POZICIJA | OTVORENA KRATKA POZICIJA | UČINAK UMANJENJA POZICIJE RADI USLUGE PROVEDBE PONUDE, ODNOSNO PRODAJE DUŽNIČKIH FINANCIJSKIH INSTRUMENTATA UZ OBVEZU OTKUPA | OTVORENA NETO DUGA POZICIJA | OTVORENA NETO KRATKA POZICIJA | UKUPNA APSOLUTNA VRIJEDNOST NETO POZICIJA | UKUPNA PONDERIRANA POZICIJA |
|---|---|---|--|---|--|--|---|---|
| Kategorija ovisi o izdavatelju/dužniku, vanjskom ili internom kreditnom rejtingu i preostalom roku dospjeća | Pripadni ponder za određenu kategoriju | Svi dužnički vrijednosni papiri koje investicijsko društvo posjeduje. Duge pozicije se unose s pozitivnim predznakom. | Svi dužnički vrijednosni papiri koje je investicijsko društvo prodalo, a nije ih posjedovalo (engl. short sell). Kratke pozicije se unose s negativnim predznakom. | Učinak umanjena investicijsko društvo računa na način da neto poziciju izračunatu tako što iznos financijskih instrumenata za koje se bezuvjetno obvezalo prihvatiti po dogovorenoj cijeni umanji za one pozicije koje su upisane ili su predmet pružanja usluge provedbe ponude odnosno prodaje dužničkih financijskih instrumenata uz obvezu otkupa. Tako dobivenu poziciju investicijsko društvo umanjuje za faktore umanjena iz članka 43. stavka 1. Pravilnika o adekvatnosti kapitala investicijskih društava (Tablica 4.). | Iznos dugih pozicija koji prelazi iznos kratkih pozicija u istim dužničkim financijskim instrumentima. | Iznos kratkih pozicija koji prelazi iznos dugih pozicija u istim dužničkim financijskim instrumentima. | Apsolutna vrijednost zbroja otvorene neto duge pozicije (stupac 6) i otvorene neto kratke pozicije (stupac 7) uključujući učinak umanjena (stupac 5). | Umnožak iznosa u stupcu 8. i pripadajućeg pondera u stupcu 9. 9=8*2 |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
| Dužnički financijski instrumenti izdani ili s garancijom od središnje države, izdani od strane središnjih banaka, međunarodnih organizacija, multilateralnih razvojnih banaka te jedinica regionalne i lokalne samouprave država članica koje ispunjavaju uvjete za stupanj 1 kreditne kvalitete ili kojima je dodijeljen ponder rizika 0% u skladu s poglavljem 1. Glave IV. Pravilnika o adekvatnosti kapitala investicijskih društava. | 0% | | | | | | | |
| | UKUPNO | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | 0,25% (preostalo vrijeme do dospjeća najviše 6 mjeseci) | | | | | | | |
| | UKUPNO | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Dužnički financijski instrumenti izdani ili s garancijom od središnje države, izdani od strane središnjih banaka, međunarodnih organizacija, multilateralnih razvojnih banaka te jedinica regionalne i lokalne samouprave država članica koje ispunjavaju uvjete za stupanj 2 ili 3 kreditne kvalitete u skladu s poglavljem 1. Glave IV. Pravilnika o adekvatnosti kapitala investicijskih društava, dužnički financijski instrumenti izdani ili s garancijom od institucija koje ispunjavaju uvjete za stupanj 1 ili 2 kreditne kvalitete u skladu s poglavljem 1. Glave IV. Pravilnika o adekvatnosti kapitala investicijskih društava, dužnički financijski instrumenti izdani ili s garancijom od trgovačkih društava koje ispunjavaju uvjete za stupanj 1 ili 2 kreditne kvalitete u skladu s poglavljem 1. Glave IV. Pravilnika o adekvatnosti kapitala investicijskih društava, ostale kvalificirajuće stavke u skladu sa člankom 30. Pravilnika o adekvatnosti kapitala investicijskih društava. | 1% (preostalo vrijeme do dospjeća 6-24 m) | | | | | | | |
| | UKUPNO | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

| | | | | | | | | |
|--|--|--|--|--|------|------|------|------|
| | 1,6% (preostalo vrijeme do dospjeća preko 24 mj) | | | | | | | |
| | UKUPNO | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Dužnički finansijski instrumenti izdani ili s garancijom od središnje države, izdani od strane središnjih banaka, međunarodnih organizacija, multilateralnih razvojnih banaka, jedinica regionalne i lokalne samouprave država članica te institucija koje ispunjavaju uvjete za stupanj 4 ili 5 kreditne kvalitete u skladu s poglavljem 1. Glave IV. Pravilnika o adekvatnosti kapitala investicijskih društava, dužnički finansijski instrumenti izdani ili s garancijom od institucija koje ispunjavaju uvjete za stupanj 3 kreditne kvalitete u skladu s poglavljem 1. Glave IV. Pravilnika o adekvatnosti kapitala investicijskih društava, dužnički finansijski instrumenti izdani ili s garancijom od trgovačkih društava koje ispunjavaju uvjete za stupanj 3 ili 4 kreditne kvalitete u skladu s poglavljem 1. Glave IV. Pravilnika o adekvatnosti kapitala investicijskih društava, izloženi za koje nije dostupna kreditna procjena od priznate VIPKR. | 8,00% | | | | | | | |
| | UKUPNO | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Dužnički finansijski instrumenti izdani ili s garancijom od središnje države, izdani od strane središnjih banaka, međunarodnih organizacija, multilateralnih razvojnih banaka, jedinica regionalne i lokalne samouprave država članica te institucija koje ispunjavaju uvjete za stupanj 6 kreditne kvalitete u skladu s poglavljem 1. Glave IV. Pravilnika o adekvatnosti kapitala investicijskih društava, dužnički finansijski instrumenti izdani ili s garancijom od trgovačkih društava koje ispunjavaju uvjete za stupanj 5 ili 6 kreditne kvalitete u skladu s poglavljem 1. Glave IV. Pravilnika o adekvatnosti kapitala investicijskih društava. | 12,00% | | | | | | | |
| | UKUPNO | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

| | |
|--|------|
| 1.1 KAPITALNI ZAHTEJ ZA SPECIFIČNI RIZIK DUŽNIČKIH FINANCIJSKIH INSTRUMENATA ZA GORNJU VALUTU | 0,00 |
|--|------|

Obrazac ORD: Opći rizik dužničkih financijskih instrumenata (pristup temeljen na dospijeću)

| |
|---|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: Opći rizik dužničkih financijskih instrumenata (pristup temeljen na dospijeću) |
| Datum: 31.12.2009. |

| | |
|---------|--|
| Valuta: | |
|---------|--|

| ZONA | RAZRED DOSPIJEĆA | | PONDER (%) | OTVORENA DUGA POZICIJA | OTVORENA KRATKA POZICIJA | UČINAK UMANJENJA POZICIJ RADI USLUGE PROVEDBE PONUDE, ODNOSNO PRODAJE DUŽNIČKIH FINANCISKIH INSTRUMENTATA UZ OBEVEZU OTKUPA | OTVORENA NETO DUGA POZICIJA | OTVORENA NETO KRATKA POZICIJA | PONDERIRANA OTVORENA NETO DUGA POZICIJA |
|---|----------------------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|--|--|--|--|--|---|
| Uključuje pripadne razrede dospijeća u stupcima 2. i 3. | | | Ponder za određeni razred dospijeća. | Duge pozicije dužničkih financijskih instrumenata se prema preostalom roku dospijeća (odnosno prema razdoblju preostalom do sljedećeg određivanja kamata kod instrumenta s promjenjivom kamatnom stopom) i kamatnoj stopi raspoređuju u odgovarajuće ćelije ovog stupca. | Kratke pozicije dužničkih financijskih instrumenata se prema preostalom roku dospijeća (odnosno prema razdoblju preostalom do sljedećeg određivanja kamata kod instrumenta s promjenjivom kamatnom stopom) i kamatnoj stopi raspoređuju u odgovarajuće ćelije ovog stupca. | Učinak umanjenja investicijskog društva na čista na dan da neto poziciju izračunatu tako što iznos financijskih instrumenata za koje se bezuvjetno obvezalo prihvatiti po dogovorenoj cijeni umanjiti za one pozicije koje su upisane ili su predmet pružanja usluge provedbe ponude odnosno prodaje dužničkih financijskih instrumenata uz obvezu otkupa. Tako dobivenu poziciju investicijsko društvo umanjuje za faktore umanjenja iz članka 43. stavka 1. Pravilnika o adekvatnosti kapitala investicijskih društava (Tablica 4.). | Iznos dugih pozicija koji prelazi iznos kratkih pozicija u istim dužničkim financijskim instrumentima. | Iznos kratkih pozicija koji prelazi iznos dugih pozicija u istim dužničkim financijskim instrumentima. | Svaka pozicija iz stupca 8. množi se s ponderom iz stupca 4. za taj razred dospijeća. |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 |
| Zona 1 | 0<=1 mjeseca (kupon veći od 3%) | 0<=1 mjeseca (kupon manji od 3%) | 0,00 | | | | | | |
| | Ukupno | | | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | >1<=3 mjeseca (kupon veći od 3%) | >1<=3 mjeseca (kupon manji od 3%) | 0,20 | | | | | | |
| | Ukupno | | | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | >3<=6 mjeseca (kupon veći od 3%) | >3<=6 mjeseca (kupon manji od 3%) | 0,40 | | | | | | |
| | Ukupno | | | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Ukupno u zoni 1 | | | | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Zona 2 | >1<=2 godine (kupon veći od 3%) | >1,0<=1,9 godina (kupon manji od 3%) | 1,25 | | | | | | |
| | Ukupno | | | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | >2<=3 godine (kupon veći od 3%) | >1,9<=2,8 godina (kupon manji od 3%) | 1,75 | | | | | | |
| | Ukupno | | | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | >3<=4 godine (kupon veći od 3%) | >2,8<=3,6 godina (kupon manji od 3%) | 2,25 | | | | | | |
| Ukupno | | | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| Ukupno u zoni 2 | | | | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

| | | | | | | | | | |
|--|--|--|------|--|--|------|------|------|------|
| Zona 3 | >4<=5 godina (kupon veći od 3%) | >3,6<=4,3 godina (kupon manji od 3%) | 2,75 | | | | | | |
| | Ukupno | | | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | >5<=7 godina (kupon veći od 3%) | >4,3<=5,7 godina (kupon manji od 3%) | 3,25 | | | | | | |
| | Ukupno | | | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | >7<=10 godina (kupon veći od 3%) | >5,7<=7,3 godina (kupon manji od 3%) | 3,75 | | | | | | |
| | Ukupno | | | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | >10<=15 godina (kupon veći od 3%) | >7,3<=9,3 godina (kupon manji od 3%) | 4,50 | | | | | | |
| | Ukupno | | | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | >15<=20 godina (kupon veći od 3%) | >9,3<=10,6 godina (kupon manji od 3%) | 5,25 | | | | | | |
| | Ukupno | | | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | >20 godina (kupon veći od 3%) | >10,6<=12,0 godina (kupon manji od 3%) | 6,00 | | | | | | |
| | Ukupno | | | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | >12,0<=20,0 godina (kupon manji od 3%) | 8,00 | | | | | | | |
| Ukupno | | | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| | >20,0 godina (kupon manji od 3%) | 12,50 | | | | | | | |
| Ukupno | | | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| Ukupno u zoni 3 | | | | | | | | | |
| 1.1. UKUPNO USKLADENA PONDERIRANA POZICIJA PO SVIM RAZREDIMA DOSPLJEĆA | | | | | | | | | |
| - Zbroj usklađenih ponderiranih pozicija u svim razredima dospijeća iz stupca 15. | | | | | | | | | |
| 1.2. USKLADENA PONDERIRANA POZICIJA U ZONI 1 | | | | | | | | | |
| - Upišujemo odgovarajuću iznos iz retka "Ukupno u zoni n" stupca 15. | | | | | | | | | |
| 1.3. USKLADENA PONDERIRANA POZICIJA U ZONI 2 | | | | | | | | | |
| - Upišujemo odgovarajuću iznos iz retka "Ukupno u zoni n" stupca 15. | | | | | | | | | |
| 1.4. USKLADENA PONDERIRANA POZICIJA U ZONI 3 | | | | | | | | | |
| - Upišujemo odgovarajuću iznos iz retka "Ukupno u zoni n" stupca 15. | | | | | | | | | |
| 1.5 USKLADENA PONDERIRANA POZICIJA IZMEDU ZONE 1 I ZONE 2 | | | | | | | | | |
| - Iznos neusklađene ponderirane duga/kratke pozicije u zoni jedan, koji je usklađen s neusklađenom ponderiranom kratkom/dugom pozicijom u zoni dva smatra se usklađenom ponderiranom pozicijom između zone jedan i zone dva. | | | | | | | | | |
| 1.6. USKLADENA PONDERIRANA POZICIJA IZMEDU ZONE 2 I ZONE 3 | | | | | | | | | |
| - Iznos preostale neusklađene ponderirane pozicije zone dva koja je usklađena s neusklađenom ponderiranom pozicijom u zoni tri smatra se usklađenom ponderiranom pozicijom između zone dva i zone tri. | | | | | | | | | |
| 1.7. USKLADENA PONDERIRANA POZICIJA IZMEDU ZONE 1 I ZONE 3 | | | | | | | | | |
| - Iznos preostale neusklađene ponderirane pozicije zone jedan koja je usklađena s neusklađenom ponderiranom pozicijom u zoni tri smatra se usklađenom ponderiranom pozicijom između zone jedan i zone tri. | | | | | | | | | |
| 1.8. PREOSTALA NEUSKLADENA PONDERIRANA POZICIJA | | | | | | | | | |
| - Iznos preostalih neusklađenih ponderiranih pozicija u svim zonama se zbraja. | | | | | | | | | |
| 1.9. KAPITALNI ZAHTEJ ZA OPĆI RIZIK DUŽNIČKIH FINANLSKIH INSTRUMENTATA ZA GORNJU VALUTU (10% od 1.1 + 40% od 1.2 + 30% od 1.3 + 30% od 1.4 + 40% od 1.5 + 40% od 1.6 + 150% od 1.7 + 100% od 1.8) | | | | | | | | | |

(u tisućama kuna)

| PONDERIRANA OTVORENA NETO KRATKA POZICIJA | USKLAĐENA PONDERIRANA POZICIJA UNUTAR RAZREDA | PREOSTALA NEUSKLAĐENA PONDERIRANA DUGA POZICIJA UNUTAR RAZREDA | PREOSTALA NEUSKLAĐENA PONDERIRANA KRATKA POZICIJA UNUTAR RAZREDA | USKLAĐENA PONDERIRANA POZICIJA UNUTAR ZONE | PREOSTALA NEUSKLAĐENA PONDERIRANA DUGA POZICIJA UNUTAR ZONE | PREOSTALA NEUSKLAĐENA PONDERIRANA KRATKA POZICIJA UNUTAR ZONE |
|--|---|---|---|--|--|--|
| Svaka pozicija iz stupca 9. množi se s ponderom iz stupca 4. za taj razred dospjeća. | Iznos zbroja ponderiranih dugih pozicija koji je usklađen sa zbrojem ponderiranih kratkih pozicija u svakom razredu dostiže ča smatra se usklađenom ponderiranom pozicijom u tom razredu dostiže ča. Pozicija se unosi s pozitivnim predznakom. | Preostali iznos, nakon usklađivanja ponderiranih pozicija unutar razreda (u stupcu 12), smatra se (dugom ili kratkom) neusklađenom ponderiranom pozicijom za taj razred dostiže ča. Ako je preostali iznos duga neusklađena ponderirana pozicija, ona se upisuje u ovaj stupac. | Preostali iznos, nakon usklađivanja ponderiranih pozicija unutar razreda (u stupcu 12), smatra se (dugom ili kratkom) neusklađenom ponderiranom pozicijom za taj razred dostiže ča. Ako je preostali iznos kratka neusklađena ponderirana pozicija, ona se upisuje u ovaj stupac. | Iznos zbroja svih dugih neusklađenih ponderiranih pozicija (iznos ukupne sume iz retka "Ukupno u zoni n" stupca 13) koji je usklađen sa zbrojem svih kratkih neusklađenih ponderiranih pozicija u istoj zoni (iznos ukupne sume iz retka "Ukupno u zoni n" stupca 14). | Preostali iznos, nakon usklađivanja ponderiranih pozicija unutar zone (u stupcu 15), smatra se (dugom ili kratkom) neusklađenom ponderiranom pozicijom te zone. Ako je takva neusklađena ponderirana pozicija duga, njen iznos se upisuje u ovom stupcu s pozitivnim predznakom. | Preostali iznos, nakon usklađivanja ponderiranih pozicija unutar zone (u stupcu 15), smatra se (dugom ili kratkom) neusklađenom ponderiranom pozicijom te zone. Ako je takva neusklađena ponderirana pozicija kratka, njen iznos se upisuje u ovom stupcu s pozitivnim predznakom. |
| 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | 16 | 17 |
| | | | | | | |
| 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | |
| | | | | | | |
| 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | |
| | | | | | | |
| 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | |
| | | | | | | |
| 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | | | | | | |
| 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | |
| | | | | | | |
| 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | |
| | | | | | | |
| 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | | | | | | |
| 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

Obrazac ORT: Opći rizik dužničkih financijskih instrumenata (pristup temeljen na trajanju)

| |
|--|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: Opći rizik dužničkih financijskih instrumenata (pristup temeljen na trajanju) |
| Datum: 31.12.2009. |

| | |
|---------|--|
| Valuta: | |
|---------|--|

| ZONA | MODIFICIRANO TRAJANJE (U GODINAMA) | PRETPOSTAVLJENA PROMJENA KAMATNE STOPE (U %) | OTVORENA DUGA POZICIJA | OTVORENA KRATKA POZICIJA | UČINAK UMANJENJA POZICIJE RADI USLUGE PROVEDBE PONUDE, ODNOSNO PRODAJE DUŽNIČKIH FINANCIJSKIH INSTRUMENTATA UZ OBVEZU OTKUPA | OTVORENA NETO DUGA POZICIJA |
|---|------------------------------------|--|---|--|---|--|
| Uključuje pripadno modificirano trajanje u stupcu 2, "Modificirano trajanje (u godinama)" | | | Duge pozicije dužničkih financijskih instrumenata se na temelju njihovog modificiranoga trajanja raspoređuju u pripadne ćelije ovog stupca. Duge pozicije se upisuju s pozitivnim predznakom. | Kratke pozicije dužničkih financijskih instrumenata se na temelju njihovog modificiranoga trajanja raspoređuju u pripadne ćelije ovoga stupca. Kratke pozicije se unose s negativnim predznakom. | Učinak umanjenja investicijsko društvo računa na način da neto poziciju izračunata tako što iznos financijskih instrumenata za koje se bezuvjetno obvezalo prihvatiti po dogovorenoj cijeni umanjuje za one pozicije koje su upisane ili su predmet pružanja usluge provedbe ponude odnosno prodaje dužničkih financijskih instrumenata uz obvezu otkupa. Tako dobivenu poziciju investicijsko društvo umanjuje za faktore umanjenja iz članka 43. stavka 1. Pravilnika o adekvatnosti kapitala investicijskih društava (Tablica 4.). | Iznos dugih pozicija koji prelazi iznos kratkih pozicija u istim dužničkim financijskim instrumentima. |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
| Zona 1 | >0<=1,0 | 1,00 | | | | |
| | Ukupno u zoni 1 | | | | | |
| Zona 2 | >1,0<=3,6 | 0,85 | | | | |
| | Ukupno u zoni 2 | | | | | |
| Zona 3 | >3,6 | 0,70 | | | | |
| | Ukupno u zoni 3 | | | | | |

| | | | | | | |
|---|--|--|--|--|--|--|
| 1.1. USKLAĐENA POZICIJA PONDERIRANA TRAJANJEM PO SVIM ZONAMA - Zbroj usklađenih pozicija ponderiranih trajanjem u svim zonama iz stupca 12. | | | | | | |
| 1.2. USKLAĐENA POZICIJA PONDERIRANA TRAJANJEM IZMEĐU ZONA 1 I 2 - Iznos neusklađene duge/kratke pozicije ponderirane trajanjem u zoni jedan koji je usklađen s neusklađenom kratkom/dugom pozicijom ponderiranom trajanjem u zoni dva smatra se usklađenom pozicijom ponderiranom trajanjem između zone jedan i zone dva. | | | | | | |
| 1.3. USKLAĐENA POZICIJA PONDERIRANA TRAJANJEM IZMEĐU ZONA 2 I 3 - Iznos preostale neusklađene pozicije ponderirane trajanjem zone dva koji je usklađen s neusklađenom pozicijom ponderiranom trajanjem zone tri smatra se usklađenom pozicijom ponderiranom trajanjem između zone dva i zone tri. | | | | | | |
| 1.4. USKLAĐENA POZICIJA PONDERIRANA TRAJANJEM IZMEĐU ZONE 1 I ZONE 3 - Iznos preostale neusklađene pozicije ponderirane trajanjem zone jedan koji je usklađen s neusklađenom pozicijom ponderiranom trajanjem zone tri smatra se usklađenom pozicijom ponderiranom trajanjem između zone jedan i zone tri. | | | | | | |
| 1.5. PREOSTALA NEUSKLAĐENA POZICIJA PONDERIRANA TRAJANJEM - Zbroj svih neusklađenih pozicija ponderiranih trajanjem u svim zonama. | | | | | | |
| 1.6. KAPITALNI ZAHTJEV ZA OPĆI RIZIK DUŽNIČKIH FINANCJSKIH INSTRUMENATA ZA GORNJU VALUTU (2% od 1.1 + 40% od 1.2 + 40% od 1.3 + 150% od 1.4 + 100% od 1.5) | | | | | | |

| | | | | | | | |
|--|--|--|--|--|------|--|--|
| | | | | | 0,00 | | |
| | | | | | 0,00 | | |
| | | | | | 0,00 | | |
| | | | | | 0,00 | | |
| | | | | | 0,00 | | |
| | | | | | 0,00 | | |
| | | | | | 0,00 | | |

Obrazac JSZU: Specifični i opći pozicijski rizik jedinica u subjektima za zajednička ulaganja

| |
|--|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: Specifični i opći pozicijski rizik jedinica u subjektima za zajednička ulaganja |
| Datum: 31.12.2009. |

(u tisućama kuna)

| POZICIJE JEDINICA U SUBJEKTIMA ZA ZAJEDNIČKA ULAGANJA | KAPITALNI ZAHTJEV |
|---|--|
| Pozicije jedinica u subjektima za zajednička ulaganja koje se ne tretiraju u skladu s člancima 45. do 49. Pravilnika o adekvatnosti kapitala investicijskih društava. | Kapitalni zahtjev za specifični i opći pozicijski rizik za jedinice u subjektima za zajednička ulaganja koje su raspoređene u knjigu trgovanja u skladu sa člankom 13. do 18. Pravilnika o adekvatnosti kapitala investicijskih društava iznosi 32%. |
| 1 | 2 |
| 0,00 | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | 0,00 |

Obrazac VFIR: Specifični i opći pozicijski rizik vlasničkih financijskih instrumenata

| |
|--|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: Specifični i opći pozicijski rizik vlasničkih financijskih instrumenata |
| Datum: 31.12.2009. |

Nacionalno tržište na koje su vlasnički financijski instrumenti uvršteni: **ZAGREB STOCK EXCHANGE (ZAGREBAČKA BURZA) - REPUBLIKA HRVATSKA**

| VRSTA | OTVORENA DUGA POZICIJA | OTVORENA KRATKA POZICIJA | UČINAK UMANJENJA POZICIJE RADI USLUGE PROVEDBE PONUDE, ODNOSNO PRODAJE VLASNIČKIH FINANCIJSKIH INSTRUMENTATA UZ OBEZU OTKUPA |
|--|--|--|---|
| Vrsta vlasničkog financijskog instrumenta. | Duga pozicija u određenom vlasničkom instrumentu iskazuje se po njegovoj tržišnoj vrijednosti. Duga pozicija upisuje se s pozitivnim predznakom. | Kratka pozicija u određenom vlasničkom instrumentu iskazuje se po njegovoj tržišnoj vrijednosti. Kratka pozicija upisuje se s negativnim predznakom. | Učinak umanjenja investicijsko društvo računa na način da neto poziciju izračunatu tako što iznos financijskih instrumenata za koje se bezuvjetno obvezalo prihvatiti po dogovorenoj cijeni umanjí za one pozicije koje su upisane ili su predmet pružanja usluge provedbe ponude odnosno prodaje dužničkih financijskih instrumenata uz obvezu otkupa. Tako dobivenu poziciju investicijsko društvo umanjuje za faktore umanjenja iz članka 43. stavka 1. Pravilnika o adekvatnosti kapitala investicijskih društava (Tablica 4.). |
| 1 | 2 | 3 | 4 |
| (1) Dionice | 206 | 0 | 0 |
| (2) Potvrde o deponiranim dionicama | 0 | 0 | 0 |
| (3) Burzovni indeksi | 0 | 0 | 0 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| (4) Zamjenjivi vrijednosni papiri | 0 | 0 | 0 |
| (5) Vlasnički financijski instrumenti nastali raščlanjivanjem izvedenih financijskih instrumenata | 0 | 0 | 0 |
| (6) Ostali oblici vlasničkih financijskih instrumenata | 0 | 0 | 0 |
| 1.1 UKUPNO UVRŠTENO NA GORE NAVEDENO NACIONALNO TRŽIŠTE | | | |
| 1.2 UKUPNI KAPITALNI ZAHTEJ ZA SPECIFIČNI I OPĆI RIZIK VLASNIČKIH FINANCIJSKIH INSTRUMENTATA ZA GORE NAVEDENO NACIONALNO TRŽIŠTE - Kapitalni zahtjev za specifični rizik iznosi 4% iznosa u stupcu 7, a za opći rizik iznosi 8% iznosa u stupcu 8. Kapitalni zahtjev za specifični i opći rizik vlasničkih financijskih instrumenata je zbroj ta dva kapitalna zahtjeva =4%*7+8%*8 | | | |

(u tisućama kuna)

| OTVORENA NETO DUGA POZICIJA | OTVORENA NETO KRATKA POZICIJA | UKUPNA BRUTO POZICIJA | UKUPNA NETO POZICIJA | KAPITALNI ZAHTEJEV |
|---|---|---|---|---|
| Iznos dugih pozicija koji prelazi iznos kratkih pozicija u istim vlasničkim financijskim instrumentima. | Iznos kratkih pozicija koji prelazi iznos dugih pozicija u istim vlasničkim financijskim instrumentima. | Zbroj svih iznosa u stupcu 5. i apsolutne vrijednosti svih iznosa u stupcu 6. | Apsolutna vrijednost zbroja svih iznosa u stupcu 5. i stupcu 6. | Kapitalni zahtjev za specifični rizik iznosi 4% iznosa u stupcu 7, a kapitalni zahtjev za opći rizik iznosi 8% iznosa u stupcu 8. Kapitalni zahtjev za specifični i opći rizik vlasničkih instrumenata je zbroj ta dva kapitalna zahtjeva i upisuje se u ovaj stupac. |
| 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
| 206 | 0 | | | |
| 0 | 0 | | | |
| 0 | 0 | | | |

| | | | | |
|-----|---|-----|-----|----|
| 0 | 0 | | | |
| 0 | 0 | | | |
| 0 | 0 | | | |
| 206 | 0 | 206 | 206 | |
| | | | | 25 |

Obrazac VR: Valutni rizik

| |
|--|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRUJEDNOSNICE D.O.O |
| ID investicijskog društva: 141868 |
| Oznaka izvještaja: Valutni rizik |
| Datum: 31.12.2009. |

| VALUTA | "SPOT" POZICIJA | | "FORWARD" POZICIJA | | POZICIJE U VALUTNIM OPCIJAMA | | STAVKE POZICIJA IMOVINE I OBEVEZA S UGRABENOM "CALL" OPCIJOM | | TRŽIŠNA VRIJEDNOST OSTALIH OPCIJA | | NETO OTVORENA |
|--|--|---------|--|-----------------|---|-----------------|---|---------|--|-----------------|--|
| | IMOVA | OBEVEZE | DUGA POZICIJA | KRATKA POZICIJA | DUGA POZICIJA | KRATKA POZICIJA | IMOVA | OBEVEZE | DUGA POZICIJA | KRATKA POZICIJA | DUGA POZICIJA |
| Unosi se oznaka valute: | Sve devizna imovina i obaveze, imovina i obaveze uz valutnu klauzulu, "spot" transakcije kupnje i prodaje deviza koje su ugovorene, ali nisu bilančno uključene, "spot" pozicije valutnih "swap" ugovora. Imovina se upisuje s pozitivnim predznakom, a obaveze s negativnim predznakom. | | "Forward" transakcije kupnje i prodaje deviza, uključujući "futurna" ugovore na tu valutu, te glavnicu valutnih "swap" ugovora koja nije uključena u "spot" poziciju, nepozicije garancije, nepolovni akreditivi i sl. Ovi instrumenti na temelju kojih se investicijsko društvo osigurava morati biti plaćeni, a postoji vjerojatnost da ta sredstva investicijsko društvo ne će moći nadoknaditi (iskazani u stranoj valuti ili uz valutnu klauzulu). Duge pozicije se upisuju s pozitivnim, a kratke s negativnim predznakom. | | Investicijsko društvo izračunava vrijednosti križne valutnih opcija za svaku valutu. Pri izračunu vrijednosti križne valutnih opcija, opcije se uključuju u delta ekvivalentu nominalne vrijednosti opcije. | | Imovina i obaveza s ugrađenom "call" opcijom zbrajaju se u njihovom nominalnom iznosu u vede iz računa o predznaku koji nose. | | Upisuje se tržišna vrijednost svake druge opcije (koja nije valutna) kod koje je temeljna varijabla iskazana u stranoj valuti. | | Upisuje se neto "spot" pozicija, neto "forward" križne valutnih opcija, neto pozicije imovina tržišna vrijednosti bilo koje druge opcije (|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 |
| EUR | 11 | -535 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 11 |
| Ukupno | | | | | | | | | | | 10,96 |
| USD | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ukupno | | | | | | | | | | | 0,00 |
| RSD | 172 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 172 |
| Ukupno | | | | | | | | | | | 171,90 |
| Ukupno | | | | | | | | | | | 0,00 |
| Ukupno | | | | | | | | | | | 0,00 |
| Ukupno | | | | | | | | | | | 0,00 |
| Ukupno | | | | | | | | | | | 0,00 |
| Pretpostavljena ulaganja subjekta za zajednička ulaganja u stranoj valuti tretirana kao zasebna valuta | | | | | | | | | | | 0,00 |
| Ukupno | | | | | | | | | | | 0,00 |

| | |
|--|---------|
| 1.1 UKUPNA NETO DUGA DEVIZNA POZICIJA Duge neto pozicije u pojedinim valutama zbrajaju se odvojeno, a zbroj nosi pozitivan predznak (+). | 171,71 |
| 1.2 UKUPNA NETO KRATKA DEVIZNA POZICIJA Kratke neto pozicije u pojedinim valutama zbrajaju se odvojeno, a zbroj nosi negativan predznak (-). | -523,59 |
| 1.3 UKUPNA NETO OTVORENA DEVIZNA POZICIJA Veći iznos po apsolutnoj vrijednosti od zbroja upisanih u redcima 1.1 i 1.2 (+MAX(1;-ABS(1.2))). | 523,59 |
| 1.4 KAPITALNI ZAHTJEV ZA VALUTNI RIZIK Ukupna neto otvorena devizna pozicija pomnožena sa 8% (+1,378%). | 41,89 |

(u tisućama kuna)

| DEVIZNA POZICIJA | UKUPNA NETO OTVORENA DEVIZNA POZICIJA U POJEDNOJ VALUTI |
|---|---|
| <small>if" pozicija, neto delta ekvivalent ukupne i obveza s ugrađenom "call" opcijom, te koja se ne odnosi na zamjenu valuta).</small> | <small>Upisuje se ukupna neto otvorena pozicija u pojedinoj valuti.</small> |
| KRATKA POZICIJA | |
| 13 | 14 |
| -535 | |
| -534,55 | -523,59 |
| 0 | |
| 0,00 | 0,00 |
| 0 | |
| -0,18 | 171,71 |
| 0,00 | 0,00 |
| 0,00 | 0,00 |
| 0,00 | 0,00 |
| 0,00 | 0,00 |
| 0,00 | 0,00 |
| 0,00 | 0,00 |
| 0,00 | 0,00 |

Obrazac RRJP: Robni rizik (jednostavni pristup)

| |
|---|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: Robni rizik (jednostavni pristup) |
| Datum: 31.12.2009. |

| | |
|----------------------------|--|
| Vrsta robe | |
| Standardna mjerna jedinica | |
| Tržišna cijena: | |

| | OTVORENA DUGA POZICIJA | OTVORENA KRATKA POZICIJA | NETO POZICIJA | TRŽIŠNA VRIJEDNOST NETO POZICIJE |
|---|---|---|--|---|
| | Duge pozicije u robi i duge pozicije u temeljnoj robi (kod izvedenih financijskih instrumenata koji se odnose na robu) nose pozitivan predznak (+). | Kratke pozicije u robi i kratke pozicije u temeljnoj robi (kod izvedenih financijskih instrumenata koji se odnose na robu) nose negativan predznak (-). | Zbroj dugih pozicija (stupac 1) i kratkih pozicija (stupac 2). | Neto pozicija u apsolutnom iznosu (stupac 3) pomnožena tržišnom cijenom robe. |
| | 1 | 2 | 3 | 4 |
| | | | | |
| | | | | |
| | | | | |
| | | | | |
| | | | | |
| | | | | |
| | | | | |
| 1.1 UKUPNO | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 1.2 UKUPNI KAPITALNI ZAHTEJ ZA ROJNI RIZIK | | | | |

(u tisućama kuna)

| BRUTO POZICIJA | TRŽIŠNA VRIJEDNOST BRUTO POZICIJE | KAPITALNI ZAHTJEV ZA NETO POZICIJU ROBE | KAPITALNI ZAHTJEV ZA BRUTO POZICIJU ROBE | KAPITALNI ZAHTJEV |
|---|---|---|--|---|
| Bruto pozicija u određenoj robi predstavlja zbroj iznosa dugih i apsolutnih iznosa kratkih pozicija u toj robi. | Bruto pozicija (iznos iz stupca 5) pomnožena tržišnom cijenom robe. | 15% tržišne vrijednosti neto pozicije $7=15\%*4$ | 3% tržišne vrijednosti bruto pozicije $8=3\%*6$ | Zbroj kapitalnih zahtjeva za neto i bruto poziciju robe. $9=7+8$ |
| 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
| | | | | |
| | | | | |
| | | | | |
| | | | | |
| | | | | |
| | | | | |
| | | | | |
| 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| | | | | 0,00 |

Obrazac RPO: Rizik pozicije u opcijama

| |
|---|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: Rizik pozicije u opcijama |
| Datum: 31.12.2009. |

| 1. METODA DELTA-PLUS | |
|--|-------------|
| 1.1 Kapitalni zahtjev za gama rizik | 0,00 |
| 1.2 Kapitalni zahtjev za vega rizik | 0,00 |
| 1.3 UKUPNI KAPITALNI ZAHTEJ ZA OPCIJE KOD DELTA-PLUS METODE | 0,00 |

| 2. JEDNOSTAVNA METODA | | | | | |
|---|--|-------------------------------------|--|--|--|
| VRSTA POZICIJE | OPIS | JEDNOZNAČNA OZNAKA POSLA | TRŽIŠNA VRIJEDNOST TEMELJNE VARIJABLE POMNOŽENA PRIPADAJUĆIM FAKTOROM | TRŽIŠNA VRIJEDNOST OPCIJE (IZNOS "IN THE MONEY") | KAPITALNI ZAHTEJEV |
| | Unosi se opis vrste opcije npr. call/valuta, put/dionica, call/obveznica i sl. | Navodi se jednoznačna oznaka posla. | Umnožak tržišne vrijednosti temeljne varijable i zbroja pripadajućih faktora za njezin specifični i opći pozicijski rizik, koji su definirani Pravilnikom o adekvatnosti kapitala investicijskih društava. | Unosi se pozitivna tržišna vrijednost opcije. | Manji od iznosa upisanih u stupac 4. Kapitalni zahtjev za temeljnu varijablu i stupac 5. Tržišna vrijednost opcije (Iznos "in the money"). |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| (1) Kupljene opcije | | | | | 0,00 |
| | | | | | 0,00 |
| | | | | | 0,00 |
| | | | | | 0,00 |
| 2.1 UKUPNO | | | | 0,00 | |
| (2) Kombinacije kupljenih opcija i pozicija u temeljnoj varijabli | | | | | 0,00 |
| | | | | | 0,00 |
| | | | | | 0,00 |
| | | | | | 0,00 |
| 2.2 UKUPNO | | | | 0,00 | |
| 2.3 UKUPNI KAPITALNI ZAHTEJ ZA OPCIJE KOD JEDNOSTAVNE METODE | | | | | 0,00 |

Obrazac RRLD: Robni rizik (pristup ljestvice dospjeća)

| |
|---|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: Robni rizik (pristup ljestvice dospjeća) |
| Datum: 31.12.2009. |

| | |
|-----------------------------|--|
| Vrsta robe: | |
| Standardna mjerna jedinica: | |
| Tržišna cijena: | |

| OZNAKA RAZREDA | RAZRED DOSPLJEĆA | STOPA NEUSKLADENOSTI DOSPLJEĆA (U %) | OTVORENA DUGA POZICIJA | OTVORENA KRATKA POZICIJA | OTVORENA NETO DUGA POZICIJA | OTVORENA NETO KRATKA POZICIJA | TRŽIŠNA VRJEDNOST NETO OTVORENE DUGE POZICIJE | TRŽIŠNA VRJEDNOST NETO OTVORENE KRATKE POZICIJE |
|----------------|------------------|--------------------------------------|---|---|---|--|--|--|
| | | | Duge pozicije u robu i duge pozicije u temeljnoj robi (kod izvedenih financijskih instrumenata koji se odnose na robu) nose pozitivan predznak (+). | Kratke pozicije u robu i kratke pozicije u temeljnoj robi (kod izvedenih financijskih instrumenata koji se odnose na robu) nose negativan predznak (-). | Iznos dugih pozicija koji prelazi iznos kratkih pozicija u određenoj vrsti robe. Ako je neto iznos duga pozicija, upisuje se u ovaj stupac s pozitivnim predznakom. | Iznos kratkih pozicija koji prelazi iznos dugih pozicija u određenoj vrsti robe. Iznos se upisuje s negativnim predznakom. | Otvorena neto duga pozicija (iznos iz stupca 6) pomnožena trenutnom tržišnom cijenom robe (iznos iz retka "Tržišna cijena"). | Otvorena neto kratka pozicija (iznos iz stupca 7) pomnožena trenutnom tržišnom cijenom robe (iznos iz retka "Tržišna cijena"). |
| 1 | 0 ≤ 1 mjesec | 1,50 | | | | | | |
| | Ukupno | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 2 | > 1 ≤ 3 mjeseca | 1,50 | | | | | | |
| | Ukupno | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 3 | > 3 ≤ 6 mjeseci | 1,50 | | | | | | |
| | Ukupno | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 4 | > 6 ≤ 12 mjeseci | 1,50 | | | | | | |
| | Ukupno | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 5 | > 1 ≤ 2 godine | 1,50 | | | | | | |
| | Ukupno | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 6 | > 2 ≤ 3 godine | 1,50 | | | | | | |
| | Ukupno | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 7 | > 3 godine | 1,50 | | | | | | |
| | Ukupno | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

| | | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|--|
| 1.1 Usklađena pozicija između razreda 1 i 2 - Iznos neusklađene duge/kratke pozicije u određenom razredu dostiže ča koji je usklađen s neusklađenom kratkom/dugom pozicijom u sljedećem razredu dostiže ča smatra se usklađenom pozicijom između ta dva razreda dostiže ča. | | | | | | |
| 1.2 Neusklađena pozicija između razreda 1 i 2 - Preostali iznos nakon usklađivanja pozicija između razreda 1 i 2 smatra se (dugom ili kratkom) neusklađenom pozicijom između ta dva razreda dostiže ča. | | | | | | |
| 1.3 Usklađene neusklađene pozicije iz retka 1.2 i razreda 3. | | | | | | |
| 1.4 Preostala neusklađena pozicija između iznosa u retku 1.2 i razreda 3. | | | | | | |
| 1.5 Usklađene neusklađene pozicije iz retka 1.4 i razreda 4. | | | | | | |
| 1.6 Preostala neusklađena pozicija između iznosa u retku 1.4 i razreda 4. | | | | | | |
| 1.7 Usklađene neusklađene pozicije iz retka 1.6 i razreda 5. | | | | | | |
| 1.8 Preostala neusklađena pozicija između iznosa u retku 1.6 i razreda 5. | | | | | | |
| 1.9 Usklađene neusklađene pozicije iz retka 1.8 i razreda 6. | | | | | | |
| 1.10 Preostala neusklađena pozicija između iznosa u retku 1.8 i razreda 6. | | | | | | |
| 1.11 Usklađene neusklađene pozicije iz retka 1.10 i razreda 7. | | | | | | |
| 1.12 Preostala neusklađena pozicija između iznosa u retku 1.10 i razreda 7. | | | | | | |
| 1.13 Zbroj usklađenih pozicija unutar svih razreda - Zbroj apsolutnih iznosa usklađenih dugih i kratkih pozicija unutar svih razreda dostiže ča. | | | | | | |
| 1.14 Zbroj neusklađenih pozicija unutar razreda i između razreda - Zbroj apsolutnog iznosa neusklađenih pozicija unutar jednog razreda dostiže ča, odnosno između dva razreda dostiže ča koji se prenosi u sljedeći razred dostiže ča. | | | | | | |
| 1.15 Preostala neusklađena pozicija - Apsolutni iznos preostale neusklađene pozicije. | | | | | | |
| 1.16 Ukupni kapitalni zahtjev za robni rizik (1.13*1.50% + 1.14*0.6% + 1.15*15%) | | | | | | |

(u tisućama kuna)

| USKLAĐENA POZICIJA UNUTAR RAZREDA | PREOSTALA NEUSKLAĐENA DUGA POZICIJA UNUTAR RAZREDA | PREOSTALA NEUSKLAĐENA KRATKA POZICIJA UNUTAR RAZREDA |
|--|---|---|
| Iznos zbroja dugih/kratkih pozicija koji je usklađen sa zbrojem kratkih/dugih pozicija u svakom razredu dopijetca smatra se usklađenom pozicijom u tom razredu dopijetca i upisuje se s pozitivnim predznakom. | Preostali iznos, nakon usklađenja pozicija unutar razreda, smatra se dugom/kratkom neusklađenom pozicijom za taj razred dopijetca. Ako je takva neusklađena ponderirana pozicija duga, njen iznos se upisuje u ovom stupcu s pozitivnim predznakom. | Preostali iznos, nakon usklađenja pozicija unutar razreda, smatra se dugom/kratkom neusklađenom pozicijom za taj razred dopijetca. Ako je takva neusklađena ponderirana pozicija kratka, njen iznos se upisuje u ovom stupcu s pozitivnim predznakom. |
| 10 | 11 | 12 |
| | | |
| 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | | |
| 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | | |
| 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | | |
| 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | | |
| 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | | |
| 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | | |
| 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | | |
| 0,00 | 0,00 | 0,00 |

Obrazac RN: Rizik namire

| |
|---|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: Rizik namire |
| Datum: 31.12.2009. |

(u tisućama kuna)

| BROJ DANA KAŠNJENJA | VRSTA INSTRUMENTA NA KOJU SE TRANSAKCIJA ODNOSI | UGOVORENA CJENA | TEKUĆA TRŽIŠNA VRIJEDNOST | RAZLIKA | KAPITALNI ZAHTEJEV |
|---|---|---|---|---|---|
| Broj radnih dana nakon datuma isporuke ili datuma predviđenoj za ispunjenje obveze. | Upisuje se vrsta instrumenta: dužnički, vlasnički financijski instrumenti, valuta ili roba. | Ugovorena vrijednost financijskog instrumenta. Ako je financijski instrument prodan unosi se negativan iznos, a ako je instrument kupljen unosi se pozitivan iznos. | Tržišna vrijednost financijskog instrumenta. Ako je financijski instrument prodan unosi se negativan iznos, a ako je instrument kupljen unosi se pozitivan iznos. | Upisuje se apsolutna vrijednost razlike između ugovorene cijene namire (iznos u stupcu 3) i tržišne vrijednosti financijskog instrumenta (iznos u stupcu 4) ukoliko je nepovoljna za investicijsko društvo. Ako ta razlika ne čini gubitak za investicijsko društvo, upisuje se vrijednost 0. | Razlika (iznos u stupcu 5.) pomnožena s faktorom (navedenim u stupcu 1.). |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 |
| 5 do 15 radnih dana (faktor 8%) | | | | 0,00 | 0,00 |
| | | | | 0,00 | 0,00 |
| | | | | 0,00 | 0,00 |
| | | | | 0,00 | 0,00 |
| | | | | 0,00 | 0,00 |
| | | | | 0,00 | 0,00 |
| 16 do 30 radnih dana (faktor 50%) | | | | 0,00 | 0,00 |
| | | | | 0,00 | 0,00 |
| | | | | 0,00 | 0,00 |
| | | | | 0,00 | 0,00 |
| | | | | 0,00 | 0,00 |
| | | | | 0,00 | 0,00 |
| 31 do 45 radnih dana (faktor 75%) | | | | 0,00 | 0,00 |
| | | | | 0,00 | 0,00 |
| | | | | 0,00 | 0,00 |
| | | | | 0,00 | 0,00 |
| | | | | 0,00 | 0,00 |
| | | | | 0,00 | 0,00 |
| preko 45 radnih dana (faktor 100%) | | | | 0,00 | 0,00 |
| | | | | 0,00 | 0,00 |
| | | | | 0,00 | 0,00 |
| | | | | 0,00 | 0,00 |
| | | | | 0,00 | 0,00 |
| | | | | 0,00 | 0,00 |
| 1.1 UKUPNI KAPITALNI ZAHTEJEV ZA RIZIK NAMIRE | | | | | 0,00 |

Obrazac PDI: Rizik prekoračenja dopuštenih izloženosti

| |
|--|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: Rizik prekoračenja dopuštenih izloženosti |
| Datum: 31.12.2009. |

(u tisućama kuna)

| VRSTA PREKORAČENJA IZLOŽENOSTI | UKUPNI IZNOS PREKORAČENJA | KAPITALNI ZAHTJEV ZA POZICIJE U KNJIZI TRGOVANJA | UKUPNI KAPITALNI ZAHTJEV |
|---|--|--|---|
| | Ukupni iznos prekoračenja dopuštenih izloženosti prema jednoj osobi ili grupi povezanih osoba. | Zbroj kapitalnih zahtjeva za specifični rizik za pozicije u knjizi trgovanja koje čine prekoračenje navedeno u stupcu 2. | Umnožak vrijednosti ukupnog iznosa prekoračenja iz stupca 2. odnosno iznosa kapitalnog zahtjeva za iznose prekoračenja iz stupca 3. i pripadajućeg faktora iz Tablice 14. članka 107. stavka 8. Pravilnika o adekvatnosti kapitala investicijskih društava. |
| 1 | 2 | 3 | 4 |
| (1) Prekoračenja koja ne traju dulje od 10 dana | | | 0,00 |
| (2) Prekoračenja koja traju dulje od 10 dana | Izloženosti do visine 40% kapitala | | 0,00 |
| | Izloženosti u visini od 40% do 60% kapitala | | 0,00 |
| | Izloženosti u visini od 60% do 80% kapitala | | 0,00 |
| | Izloženosti u visini od 80% do 100% kapitala | | 0,00 |
| | Izloženosti u visini od 100% do 250% kapitala | | 0,00 |
| | Izloženosti preko 250% kapitala | | 0,00 |
| 1.1 UKUPNI KAPITALNI ZAHTJEV ZA RIZIK PREKORAČENJA NAJVEĆIH DOPUŠTENIH IZLOŽENOSTI | | | 0,00 |

Obrazac IM: Pozicijski rizik, valutni rizik i/ili robni rizik primjenom internih model:

| |
|---|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: Pozicijski rizik, valutni rizik i/ili robni rizik primjenom internih model |
| Datum: 31.12.2009. |

(u tisućama kuna)

| | MULTIPLIKACIJSKI FAKTOR X PROSJEK DNEVNIH MJERA RIZIČNOSTI VRIJEDNOSTI (VAR) ZA PRETHODNIH 60 RADNIH DANA | MJERA RIZIČNOSTI VRIJEDNOSTI (VAR) ZA PRETHODNI DAN | DODATNI KAPITALNI ZAHTJEV ZA RIZIK NEISPUNJAVANJA OBVEZA | KAPITALNI ZAHTJEV | BROJ PREKORAČENJA U RAZDOBLJU OD 250 RADNIH DANA | MULTIPLIKACIJSKI FAKTOR |
|--|--|---|---|----------------------|---|----------------------------|
| | 1 | 2 | 3 | 4=Max [1,2]+3 | 5 | 6 |
| UKUPNO | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Rastavljanje svakog posebnog tržišnog rizika: | | | | | | |
| 1. Dužnički financijski instrumenti | | | | | | |
| 1.1. Opći rizik | | | | | | |
| 1.2. Specifični rizik | | | | | | |
| 2. Vlasnički financijski instrumenti | | | | | | |
| 2.1. Opći rizik | | | | | | |
| 2.2. Specifični rizik | | | | | | |
| 3. Valutni rizik | | | | | | |
| 4. Robni rizik | | | | | | |
| 5. Ukupan iznos za opći rizik | | | | | | |
| 6. Ukupan iznos za specifičan rizik | 0 | 0 | 0 | | | |

Obrazac IM-DET: Pozicijski rizik, valutni rizik i/ili robni rizik primjenom internih modela - detaljan pregled

| |
|---|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: Pozicijski rizik, valutni rizik i/ili robni rizik primjenom internih modela - detaljan pregled |
| Datum: 31.12.2009. |

| OSNOVNI PODACI | | | | | |
|---|---|--|---|---|----------------------------------|
| REGULATORNI VaR | | | | INTERNI VaR | |
| OZNAKA INSTRUMENTA ZA REGULATORNI MODEL | OZNAKA IZRAČUNA ZA SPECIFIČNI RIZIK VLASNIČKIH FINANCIJSKIH INSTRUMENTA | OZNAKA IZRAČUNA ZA SPECIFIČNI RIZIK DUŽNIČKIH FINANCIJSKIH INSTRUMENTA | OZNAKA PROMJENE VRIJEDNOSTI PORTFELJA ZA IZRAČUN BROJA PREKORAČENJA | JEDNOSTRANI INTERVAL POUZDANOSTI INTERNOG VaR-a | RAZDOBLJE DRŽANJA INTERNOG VaR-a |
| 1 | 2 | 3 | 4 | (a) | (b) |
| | | | | | |

(u tisućama kuna)

| Redni broj dana | Regulatorni VaR | | | Interni VaR (c) | Limit internog VaR-a | Promjena vrijednosti portfelja korištena za retroaktivno testiranje | |
|-----------------|----------------------------|-----------|--|--------------------|----------------------|---|---------|
| | Interval pouzdanosti = 99% | | Dodatni kapitalni zahtjev za rizik neispunjavanja obveza | | | Hipotetična | Stvarna |
| | VaR (T=10) | VaR (T=1) | | | | | |
| 7 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 |
| 1 | | | | | | | |
| 2 | | | | | | | |
| 3 | | | | | | | |
| 4 | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|-----|--|--|--|--|--|--|--|
| 5 | | | | | | | |
| 6 | | | | | | | |
| 7 | | | | | | | |
| 8 | | | | | | | |
| 9 | | | | | | | |
| 10 | | | | | | | |
| ... | | | | | | | |
| ... | | | | | | | |
| 91 | | | | | | | |
| 92 | | | | | | | |

- (a) Ispunjava se u slučaju kad se izračun internog VaR-a temelji na intervalu pouzdanosti koji je različit od 99%
- (b) Ispunjava se u slučaju kada se izračun internog VaR-a temelji na razdoblju držanja različitom od 10 dana
- (c) Ispunjava se u slučaju kada se izračun internog VaR-a razlikuje od stupaca 8 ili 9

Obrazac KRSP: Kreditni rizik, rizik druge ugovorne strane i rizik slobodnih isporuka izračunati prema standardiziranom pristupu

| |
|--|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: KRSP: potraživanja ili potencijalna potraživanja od središnje države ili središnjih banaka. |
| Datum: 31.12.2009. |

| | BRUTO IZLOŽENOST | PROIZAŠLO IZ DRUGE UGOVORNE STRANE | (-) ISPRAVCI VRIJEDNOSTI I REZERVACIJE | | TEHNIKE UMANJENJA KREDITNOG RIZIKA - EFEKTI ZAMJENE NA IZLOŽENOST | | | | |
|---|------------------|------------------------------------|--|---------------|---|---------------------|---|--|------------------|
| | | | | | NEMATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA: PRILAGOĐENE VRIJEDNOSTI (GA) | | MATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA | | EFEKTI ZA |
| | | | | | GARANCJE | KREDITNE IZVEDENICE | JEDNOSTAVNA METODA FINANIJSKOG KOLATERALA | OSTALI INSTRUMENTI MATERIJALNE ZAŠTITE | (-) UKUPNI ODNOS |
| 1 | 2 | 3 | 4=1+3 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | |
| UKUPNA IZLOŽENOST | 181,02 | 0,00 | 0,00 | 181,02 | | | | | |
| RASPOREĐIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI S OBZIROM NA VRSTU IZLOŽENOSTI | | | | | | | | | |
| Bilančne stavke | 181,02 | | 0,00 | 181,02 | | | | | |
| Izvanbilančne stavke | 0,00 | | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| Maržne transakcije i transakcije s dugim rokom namire | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| Izvedeni finansijski instrumenti | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| Ugovori o netranju između različitih kategorija proizvoda | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| RASPOREĐIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI PREMA PONDERIMA RIZIKA | | | | | | | | | |
| 0% | 181,02 | 0,00 | 0,00 | 181,02 | | | | | |
| 10% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 20% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 35% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 50% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| od čega: bez procjene priznate VIP/KR III AKI | 181,02 | 0,00 | 0,00 | 181,02 | | | | | |
| dospjela nenaplaćena potraživanja | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| osigurano poslovnim nekretninom | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 75% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 100% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| od čega: bez procjene priznate VIP/KR III AKI | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| dospjela nenaplaćena potraživanja | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| osigurano nekretninom | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 150% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| od čega: dospjela nenaplaćena potraživanja | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 200% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| Ostali ponderi rizika | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |

Obrazac KRSP: Kreditni rizik, rizik druge ugovorne strane i rizik slobodnih isporuka izračunati prema standardiziranom pristupu

| |
|--|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: KRSP: potraživanja ili potencijalna potraživanja od institucija |
| Datum: 31.12.2009. |

| | BRUTO IZLOŽENOST | PROIZAŠLO IZ DRUGE UGOVORNE STRANE | (-) ISPRAVCI VRIJEDNOSTI I REZERVACIJE | 4=1+3 | TEHNIKE UMANJENJA KREDITNOG RIZIKA - EFEKTI ZAMIJENE NA IZLOŽENOST | | | | |
|--|------------------|------------------------------------|--|---------------|--|---------------------|--|--|------------------|
| | | | | | NEMATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA: PRILAGOĐENE VRIJEDNOSTI (GA) | | MATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA | | EFEKTI ZA |
| | | | | | GARANCIJE | KREDITNE IZVEDENICE | JEDNOSTAVNA METODA FINANCIJSKOG KOLATERALA | OSTALI INSTRUMENTI MATERIJALNE ZAŠTITE | (-) UKUPNI ODNOS |
| | | | | | 1 | 2 | 3 | 4=1+3 | 5 |
| UKUPNA IZLOŽENOST | 700,00 | 0,00 | 0,00 | 700,00 | | | | | |
| RASPOREĐIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI S OBIROM NA VRSTU IZLOŽENOSTI | | | | | | | | | |
| Bilančne stavke | 700,00 | | 0,00 | 700,00 | | | | | |
| Izvanbilančne stavke | 0,00 | | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| Maržne transakcije i transakcije s dugim rokom namire | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| Izvedeni financijski instrumenti | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| Ugovori o netiranju između različitih kategorija proizvoda | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| RASPOREĐIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI PREMA PONDERIMA RIZIKA | | | | | | | | | |
| 0% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 10% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 20% | 700,00 | 0,00 | 0,00 | 700,00 | | | | | |
| 35% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 50% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| od čega: bez procjene priznate VIPKR ili AKI | 700,00 | 0,00 | 0,00 | 700,00 | | | | | |
| dospjela nenaplaćena potraživanja | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| osigurano poslovnim nekretninom | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 75% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 100% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| od čega: bez procjene priznate VIPKR ili AKI | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| dospjela nenaplaćena potraživanja | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| osigurano nekretninom | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 150% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| od čega: dospjela nenaplaćena potraživanja | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 200% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| Ostali ponderi rizika | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |

Obrazac KRSP: Kreditni rizik, rizik druge ugovorne strane i rizik slobodnih isporuka izračunati prema standardiziranom pristupu

| |
|--|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: KRSP: potraživanja ili potencijalna potraživanja od trgovačkih društava |
| Datum: 31.12.2009. |

| | BRUTO IZLOŽENOST | | (-) ISPRAVCI VRIJEDNOSTI I REZERVACIJE | 4=1+3 | TEHNIKE UMANJENJA KREDITNOG RIZIKA - EFEKTI ZAMJENE NA IZLOŽENOST | | | | |
|---|------------------|-------------|--|-----------------|---|--------------------|---|--|-------------------------------|
| | 1 | 2 | | | NEMATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA: PRILAGOĐENE VRIJEDNOSTI (GA) | | MATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA | | EFEKTI ZA (-) UKUPNI ODNOS |
| | | | | | GARANCIJE | KREDITNE IZVEDENCE | JEDNOSTAVNA METODA FINANCUSKOG KOLATERALA | OSTALI INSTRUMENTI MATERIJALNE ZAŠTITE | |
| | | | | | | | | | |
| 9 | | | | | | | | | |
| UKUPNA IZLOŽENOST | 6.214,32 | 0,00 | 0,00 | 6.214,32 | | | | | |
| RASPOREĐIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI S OZBIROM NA VRSTU IZLOŽENOSTI | | | | | | | | | |
| Bilančne stavke | 6.214,32 | | -400,00 | 5.814,32 | | | | | |
| Izvanbilančne stavke | 0,00 | | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| Maržne transakcije i transakcije s dugim rokom namire | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| Izvedeni financijski instrumenti | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| Ugovori o netiranju između različitih kategorija proizvoda | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| RASPOREĐIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI PREMA PONDERIMA RIZIKA | | | | | | | | | |
| 0% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 10% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 20% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 35% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 50% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| od čega: bez procjene priznate VIPKR ili AKI | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| dospjela nenaplaćena potraživanja | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| osigurano poslovnim nekretninom | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 75% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 100% | 5.814,32 | 0,00 | 0,00 | 5.814,32 | | | | | |
| od čega: bez procjene priznate VIPKR ili AKI | 5.814,32 | 0,00 | 0,00 | 5.814,32 | | | | | |
| dospjela nenaplaćena potraživanja | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| osigurano nekretninom | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 150% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| od čega: dospjela nenaplaćena potraživanja | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 200% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| Ostali ponderi rizika | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |

Obrazac KRSP: Kreditni rizik, rizik druge ugovorne strane i rizik slobodnih isporuka izračunati prema standardiziranom pristupu

| |
|---|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: KRSP: potraživanja i potencijalna potraživanja od stanovništva |
| Datum: 31.12.2009. |

| | BRUTO IZLOŽENOST | | (-) ISPRAVCI VRJEDNOSTI I REZERVACIJE | 4=1+3 | TEHNIKE UMANJENJA KREDITNOG RIZIKA - EFEKTI ZAMIJENE NA IZLOŽENOST | | | | | | |
|---|------------------|-------|---------------------------------------|-------|--|---|--------------------|--|--|------------------|------------------|
| | 1 | 2 | | | 3 | NEMATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA: PRILAGOĐENE VRJEDNOSTI (GA) | | MATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA | | EFEKTI ZAMIJENE | |
| | | | | | | GARANCIJE | KREDITNE IZVEDENCE | JEDNOSTAVNA METODA FINANCIJSKOG KOLATERALA | OSTALI INSTRUMENTI MATERIJALNE ZAŠTITE | (-) UKUPNI ODNOS | (+) UKUPNI DONOS |
| | | | | | | | | | | | |
| UKUPNA IZLOŽENOST | | 15,17 | 0,00 | 0,00 | 15,17 | | | | | | |
| RASPOREĐIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI S ODBIROM NA VRSTU IZLOŽENOSTI | | | | | | | | | | | |
| Bilančne stavke | 15,17 | | 0,00 | 15,17 | | | | | | | |
| Izvanbilančne stavke | 0,00 | | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| Maržne transakcije i transakcije s dugim rokom namire | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| Izvedeni finansijski instrumenti | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| Ugovori o netranju između različitih kategorija proizvođa | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| RASPOREĐIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI PREMA PONDERIMA RIZIKA | | | | | | | | | | | |
| 0% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| 10% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| 20% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| 35% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| 50% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| od čega: bez procjene priznate VIPKR ili AKI | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| dospjela nenaplaćena potraživanja | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| osigurano poslovnom nekretninom | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| 75% | 15,17 | 0,00 | 0,00 | 15,17 | | | | | | | |
| 100% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| od čega: bez procjene priznate VIPKR ili AKI | 15,17 | 0,00 | 0,00 | 15,17 | | | | | | | |
| dospjela nenaplaćena potraživanja | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| osigurano nekretninom | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| 150% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| od čega: dospjela nenaplaćena potraživanja | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| 200% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| Ostali ponderi rizika | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |

Obrazac KRSP: Kreditni rizik, rizik druge ugovorne strane i rizik slobodnih isporuka izračunati prema standardiziranom pristupu

| |
|--|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: KRSP: dospjela nenaplaćena potraživanja |
| Datum: 31.12.2009. |

| | BRUTO IZLOŽENOST | | (-) ISPRAVCI VRJEDNOSTI I REZERVACIJE | 4=1+3 | TEHNIKE UMANJENJA KREDITNOG RIZIKA - EFEKTI ZAMJENE NA IZLOŽENOST | | | | | | NETO IZLOŽENOST NAKON PRIMJENE METODE ZAMJENE TEHNIKA UMANJENJA KREDITNOG RIZIKA I PRUJE KORISTENJA KONVERZJSKIH FAKTORA |
|--|------------------|---|---------------------------------------|--------------|---|--------------------------|--|---|-----------------------|------------------------|--|
| | 1 | 2 PROIŽAŠLO IZ DRUGE UGOVORNE STRANE | | | NEMATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA: PRILAGOĐENE VRJEDNOSTI (GA) | | MATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA | | EFEKTI ZAMJENE | | |
| | | | | | 5 GARANCIJE | 6 KREDITNE IZVEDENICE | 7 JEDNOSTAVNA METODA FINANIJSKOG KOLATERALA | 8 OSTALI INSTRUMENTI MATERIJALNE ZAŠTITE | 9 (-) UKUPNI ODNOS | 10 (+) UKUPNI DONOS | |
| UKUPNA IZLOŽENOST | 37,15 | 0,00 | 0,00 | 37,15 | | | | | | | 37,15 |
| RASPOREDIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI S OBIROM NA VRSTU IZLOŽENOSTI | | | | | | | | | | | |
| Bilančne stavke | 37,15 | | 0,00 | 37,15 | | | | | | | 37,15 |
| Izvanbilančne stavke | 0,00 | | 0,00 | 0,00 | | | | | | | 0,00 |
| Maržne transakcije i transakcije s dugim rokom namire | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | 0,00 |
| Izvedeni finansijski instrumenti | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | 0,00 |
| Ugovori o netranju između različitih kategorija proizvoda | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | 0,00 |
| RASPOREDIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI PREMA PONDERIMA RIZIKA | | | | | | | | | | | |
| 0% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| 10% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| 20% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| 35% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| 50% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| od čega: bez procjene priznate VIPKR ili AKI | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| dospjela nenaplaćena potraživanja | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| osigurano poslovnim nekretninom | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| 75% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| 100% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| od čega: bez procjene priznate VIPKR ili AKI | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| dospjela nenaplaćena potraživanja | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| osigurano nekretninom | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| 150% | 37,15 | 0,00 | 0,00 | 37,15 | | | | | | | |
| od čega: dospjela nenaplaćena potraživanja | 37,15 | 0,00 | 0,00 | 37,15 | | | | | | | |
| 200% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| Ostali ponderi rizika | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |

Obrazac KRSP: Kreditni rizik, rizik druge ugovorne strane i rizik slobodnih isporuka izračunati prema standardiziranom pristupu

| |
|--|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: KRSP: kratkoročna potraživanja od institucija i trgovačkih društava |
| Datum: 31.12.2009. |

| | BRUTO IZLOŽENOST | | (-) ISPRAVCI VRJEDNOSTI I REZERVACIJE | 4=1+3 | TEHNIKE UMANJENJA KREDITNOG RIZIKA - EFEKTI ZAMJENE NA IZLOŽENOST | | | | | | NETO IZLOŽENOST NAKON PRIMJENE METODE ZAMJENE TEHNIKA UMANJENJA KREDITNOG RIZIKA I PRUJE KORIŠTENJA KONVERZJSKIH FAKTORA |
|--|------------------|---|---------------------------------------|---------------|---|--------------------------|--|---|-----------------------|------------------------|--|
| | 1 | 2 PROIZAŠLO IZ DRUGE UGOVORNE STRANE | | | NEMATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA: PRILAGODENE VRJEDNOSTI (GA) | | MATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA | | EFEKTI ZAMJENE | | |
| | | | | | 5 GARANCIJE | 6 KREDITNE IZVEDENICE | 7 JEDNOSTAVNA METODA FINANIJSKOG KOLATERALA | 8 OSTALI INSTRUMENTI MATERIJALNE ZAŠTITE | 9 (-) UKUPNI ODNOS | 10 (+) UKUPNI DONOS | |
| UKUPNA IZLOŽENOST | 238,28 | 0,00 | 0,00 | 238,28 | | | | | | | 238,28 |
| RASPOREDIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI S OBIROM NA VRSTU IZLOŽENOSTI | | | | | | | | | | | |
| Bilančne stavke | 238,28 | | 0,00 | 238,28 | | | | | | | 238,28 |
| Izvanbilančne stavke | 0,00 | | 0,00 | 0,00 | | | | | | | 0,00 |
| Maržne transakcije i transakcije s dugim rokom namire | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | 0,00 |
| Izvedeni finansijski instrumenti | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | 0,00 |
| Ugovori o netranju između različitih kategorija proizvoda | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | 0,00 |
| RASPOREDIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI PREMA PONDERIMA RIZIKA | | | | | | | | | | | |
| 0% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| 10% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| 20% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| 35% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| 50% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| od čega: bez procjene priznate VIPRK ili AKI | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| dospjela nenaplaćena potraživanja | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| osigurano poslovnim nekretninom | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| 75% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| 100% | 238,28 | 0,00 | 0,00 | 238,28 | | | | | | | |
| od čega: bez procjene priznate VIPRK ili AKI | 238,28 | 0,00 | 0,00 | 238,28 | | | | | | | |
| dospjela nenaplaćena potraživanja | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| osigurano nekretninom | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| 150% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| od čega: dospjela nenaplaćena potraživanja | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| 200% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| Ostali ponderi rizika | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |

Obrazac KRSP: Kreditni rizik, rizik druge ugovorne strane i rizik slobodnih isporuka izračunati prema standardiziranom pristupu

| |
|---|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: KRSP: ostale stavke |
| Datum: 31.12.2009. |

| | BRUTO IZLOŽENOST | | (-) ISPRAVCI VRIJEDNOSTI I REZERVACIJE | 4=1+3 | TEHNIKE UMANJENJA KREDITNOG RIZIKA - EFEKTI ZAMIJENE NA IZLOŽENOST | | | | |
|---|------------------|-------------|--|-----------------|--|---------------------|--|--|------------------|
| | 1 | 2 | | | NEMATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA: PRILAGODENE VRIJEDNOSTI (GA) | | MATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA | | EFEKTI ZA |
| | | | | | GARANCIJE | KREDITNE IZVEDENICE | JEDNOSTAVNA METODA FINANCIJSKOG KOLATERALA | OSTALI INSTRUMENTI MATERIJALNE ZAŠTITE | (-) UKUPNI ODNOS |
| | 5 | 6 | | | 7 | 8 | 9 | | |
| UKUPNA IZLOŽENOST | 2.556,04 | 0,00 | 0,00 | 2.556,04 | | | | | |
| RASPOREĐIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI S OBZIROM NA VRSTU IZLOŽENOSTI | | | | | | | | | |
| Bilančne stavke | 2.556,04 | | 0,00 | 2.556,04 | | | | | |
| Izvanbilančne stavke | 0,00 | | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| Maržne transakcije i transakcije s dugim rokom namire | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| Izvedeni finansijski instrumenti | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| Ugovori o netiranju između različitih kategorija proizvoda | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| RASPOREĐIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI PREMA PONDERIMA RIZIKA | | | | | | | | | |
| 0% | 136,71 | 0,00 | 0,00 | 136,71 | | | | | |
| 10% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 20% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 35% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 50% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| od čega: bez procjene priznate VIPKR ili AKI | 136,71 | 0,00 | 0,00 | 136,71 | | | | | |
| dospjela nenaplaćena potraživanja | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| osigurano poslovnom nekretninom | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 75% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 100% | 2.419,33 | 0,00 | 0,00 | 2.419,33 | | | | | |
| od čega: bez procjene priznate VIPKR ili AKI | 2.419,33 | 0,00 | 0,00 | 2.419,33 | | | | | |
| dospjela nenaplaćena potraživanja | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| osigurano nekretninom | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 150% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| od čega: dospjela nenaplaćena potraživanja | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| 200% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |
| Ostali ponderi rizika | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | |

| |
|---|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: Operativni rizik |
| Datum: 31.12.2009. |

| I. POSLOVI INVESTICIJSKOG DRUŠTVA | II. RELEVANTNI POKAZATELJI | | | III. KAPITALNI ZAHTEJEV | PREMA METODOLOGIJI ZA MEĐUSOBNU PODJELU KAPITALNIH ZAHTEJEVA | IV. ELEMEN KAPITALNI ZAHTEJEV PRIJE SMANJENJA ZBOG OČEKIVANOG GUBITKA OBUHVAĆENOG POSLOVNIM PRAKSAMA I/ILI ZBOG UZIMANJA U OBZIR UČINAKA OSIGURANJA I DRUGIH MEHANIZAMA ZA PRIJENOS RIZIKA |
|------------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------------------|---|--|
| | POSLOVNA GODINA (x-3) | POSLOVNA GODINA (x-2) | POSLOVNA GODINA (x-1) | | | |
| | 1 | 2 | 3 | | | |
| A - JEDNOSTAVNI PRISTUP | 30.277 | 7.725 | 5.788 | 2.189 | | 6=4+7+8 |
| B - STANDARDIZIRANI PRISTUP | | | | | | |
| POSLOVNE LINJE: | | | | | | |
| KORPORATIVNO FINANCIRANJE | | | | | | |
| TRGOVNJE I PRODAJA | | | | | | |
| PRUŽANJE INVESTICIJSKIH USLUGA | | | | | | |
| MALOM ULAGATELJU | | | | | | |
| PLAĆANJA I NAMIRE | | | | | | |
| AGENCIJSKE USLUGE | | | | | | |
| UPRAVLJANJE IMOVINOM | | | | | | |
| C - NAPREDNI PRISTUP | | | | | | |

(u tisućama kuna)

NETI IZRAČUNA KAPITALNOG ZAHTJEVA PREMA NAPREDNOM PRISTUPU

| SMANJENJE KAPITALNOG ZAHTJEVA ZBOG OČEKIVANIH GUBITAKA KOJI SU OBUHVAĆENI POSLOVNIM PRAKSAMA | SMANJENJE KAPITALNOG ZAHTJEVA ZBOG UZIMANJA U OBZIR UČINAKA PRIZNATOG OBLIKA OSIGURANJA I DRUGIH MEHANIZAMA ZA PRIJENOS RIZIKA | OD ČEGA: ZBOG PRIZNAVANJA UČINAKA POLICE OSIGURANJA | POSTOTAK UVAŽAVANJA OGRANIČENJA ZA SMANJENJE KAPITALNOG ZAHTJEVA |
|--|---|--|---|
| 7 | 8 | 9 | 10 |
| | | | |
| | | | |

