

FIMA VRIJEDNOSNICE d.o.o. VARAŽDIN

Izvješća o adekvatnosti kapitala investicijskog društva

Obrazac o izračunima kapitala i kapitalnih zahtjeva za rizike kojima je investicijsko društvo izloženo za mjesec prosinac 2012.

Obrazac K: Kapital

Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O.
MB investicijskog društva: 1418661
Oznaka izvještaja: K: Kapital
Datum:31.12.2012.

Oznaka pozicije	STAVKA	IZNOS (u tisućama kuna)
1.	KAPITAL	6.113
1.1.	Izračun osnovnog kapitala	
1.1.1.	Uplaćene redovne dionice	0
1.1.2.	Uplaćene nekumulativne povlaštene dionice	0
1.1.3.	Uplaćeni poslovni udjeli	6.300
1.1.4.	Rezerve formirane iz dobiti nakon oporezivanja	0
1.1.4.1.	<i>zakonske</i>	0
1.1.4.2.	<i>statutarne</i>	0
1.1.4.3.	<i>za otkup vlastitih dionica</i>	0
1.1.4.4.	<i>ostale rezerve</i>	0
1.1.5.	Rezerve kapitala (redovnih i nekumulativnih povlaštenih dionica)	0
1.1.6.	Zadržana dobit	0
1.1.7.	Dobit tekuće godine	0
1.1.7.1.	<i>na osnovu godišnjeg financijskog izvještaja</i>	0
1.1.7.2.	<i>na osnovu financijskih izvještaja za razdoblja tijekom godine</i>	0
1.1.8.	Zbroj stavki (1.1.1 do 1.1.7)	6.300
1.1.9.	Stečene vlastite dionice	0
1.1.9.1.	<i>redovne dionice</i>	0
1.1.9.2.	<i>nekumulativne povlaštene dionice</i>	0
1.1.10.	Nematerijalna imovina	0
1.1.11.	Zadržani gubici	-1.393
1.1.12.	Gubitak tekuće godine	-370
1.1.12.1.	<i>na osnovu godišnjeg financijskog izvještaja</i>	0
1.1.12.2.	<i>na osnovu financijskih izvještaja za razdoblja tijekom godine</i>	0
1.1.13.	Rezerve kapitala (redovnih i nekumulativnih povlaštenih dionica)	0
1.1.14.	Zbroj stavki (1.1.9. do 1.1.13.)	-1.762
1.1.15.	Manjinski interesi	0
1.1.16.	Negativne konsolidirane rezeve	0
1.1.17.	Pozitivne konsolidirane rezerve	0
1.1.18.	Zbroj stavki (1.1.15. do 1.1.17.)	0
A.	OSNOVNI KAPITAL	4.538
1.2.	Izračun dopunskog kapitala I	
1.2.1.	Posebne rezerve	1.576
1.2.1.1.	<i>dugotrajne materijalne imovine</i>	1.407
1.2.1.2.	<i>dugotrajne financijske imovine</i>	168
1.2.1.3.	<i>efekt primjene metode zamjenske vrijednosti</i>	0
1.2.1.4.	<i>efekt vrednovanja u uvjetima inflacije</i>	0
1.2.2.	Kumulativne povlaštene dionice s pripadnim rezervama kapitala	0
1.2.2.1.	<i>neodređenog dospjeća</i>	0
1.2.2.2.	<i>fiksnog dospjeća</i>	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.)	1.576
1.2.8.	Dopunski kapital I iznad ograničenja	0

B.	DOPUNSKI KAPITAL I	1.576
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	0
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	0
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	0
1.4.4.	Udjeli u društvima za osiguranje, reosiguranje i koncernima osiguravatelja i ulaganja u instrumente tih pravnih osoba	0
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	0
1.4.6.	Prenesena vrijednost uvećana za trenutni iznos pozitivne izloženosti u slučaju slobodne isporuke, pri izračunu kapitalnih zahtjeva za rizik namire	0
1.4.7.	Zbroj stavki (od 1.4.1 do 1.4.6)	0
1.4.8.	Odbitne stavke na teret osnovnog kapitala	0
1.4.8.1.	50% ukupnog iznosa odbitnih stavki kapitala	0
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	0
1.4.9.1.	50% ukupnog iznosa odbitnih stavki kapitala	0
D.	ODBITNE STAVKE KAPITALA	0
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)	0
1.6.2.	skupštinske odluke (isplaćene dividende tekuće godine)	0
1.6.3.	rezerve kapitala ostvarene emisijom dionica	0
1.6.4.	dobit prethodne godine (rezerve za vlastite dionice)	0
1.6.5.	neuključena dobit tekuće godine	0
1.6.6.	nerealizirani gubitak s osnova vrijednosnog usklađenja financijske imovine raspoložive za prodaju	0
1.6.7.	ispravci vrijednosti i rezervacije prema IRB pristupu	0
1.6.7.1.	od toga: na pojedinačnoj osnovi	0
1.6.7.2.	od toga: na konsolidiranoj osnovi	0
1.6.8.	očekivani gubitak prema IRB pristupu	0
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: 31.12.2012.

Oznaka pozicije	STAVKA	IZNOS (u tisućama kuna)	POKRIVENOST OSNOVNIM KAPITALOM	POKRIVENOST DOPUNSKIM KAPITALOM I	POKRIVENOST DOPUNSKIM KAPITALOM II
1.	KAPITAL	6.113			
A.	OSNOVNI KAPITAL	4.538			
B.	DOPUNSKI KAPITAL I	1.576			
C.	DOPUNSKI KAPITAL II	0			
2.	KAPITALNI ZAHTEVI	1.113			
2.1.	Izračun kapitalnih zahtjeva za kreditni rizik, rizik druge ugovorne strane i rizik slobodnih isporuka				
2.1.1.	Standardizirani pristup	522			
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	0			
2.1.1.1.a.07.	Trgovačka društva	310			
2.1.1.1.a.08.	Stanovništvo	0			
2.1.1.1.a.09.	Osigurane nekretninama	0			
2.1.1.1.a.10.	Dospjela nenaplaćena potraživanja	14			
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	44			
2.1.1.1.a.14.	Potraživanja u obliku ulaganja u subjekte za zajednička ulaganja	0			
2.1.1.1.a.15.	Ostale izloženosti	153			
F.	KAPITALNI ZAHTEV ZA KREDITNI RIZIK, RIZIK DRUGE UGOVORNE STRANE I RIZIK SLOBODNE ISPORUKE	522	522	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				
2.3.1.	Pozicijski rizik, valutni rizik i robni rizik izračunati prema standardiziranim pristupima	20	20	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	0	0	0	0
2.3.1.7.	Valutni rizik	20	20	0	0
2.3.1.8.	Robni rizik (jednostavni pristup)	0	0	0	0
2.3.1.9.	Robni rizik (pristup lestvice 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 ZAHTEJ ZA POZICIJSKI RIZIK, VALUTNI RIZIK I ROBNII RIZIK	20	20	0	0
2.4.	Izračun kapitalnog zahtjeva za operativni rizik				
2.4.1.	Jednostavni pristup	572	572	0	
2.4.2.	Standardizirani pristup	0	0	0	
2.4.3.	Napredni pristup	0	0	0	
I.	KAPITALNI ZAHTEJ ZA OPERATIVNI RIZIK	572	572	0	
2.5.	Izračun kapitalnog zahtjeva prema članku 177. ZTK (1/4 općih troškova iz prethodne poslovne godine)				
J.	KAPITALNI ZAHTEJ 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 pokrća kapitalnih zahtjeva izuzimajući druge kapitalne zahtjeve	5.000			
2.7.1.a.	Adekvatnost kapitala izuzimajući kapitalni zahtjev za rizik prekoračenja dopuštenih izloženosti	5,49			
2.8.	Višak (+)/manjak (-) kapitala	113			
2.8.a.	Adekvatnost kapitala	5,49			
2.9.	Višak (+)/manjak (-) kapitala uzevši u obzir nadzorne mjere	N/A			
2.9.a.	Adekvatnost kapitala uzeši 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:31.12.2012.

Sastavio:

Stiven Toš, Risk manager

Telefonski broj: 042/660-975

Žig i potpis odgovorne osobe:

Snježana Mihinjač Horvat, predsjednik Uprave

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

(u tisućama kuna)

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

Datum:31.12.2012.

Sastavio:

Žig i potpis odgovorne osobe:

Stiven Toš, Risk manager

Snežana Mihinjač Horvat, predsjednik Uprave

Telefonski broj: 042/660-975

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 KT: Knjiga trgovanja - dnevna stanja

Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.C
MB investicijskog društva: 1418661
Datum:31.12.2012.

(u tisućama kuna)

Redni broj	Datum/Radni dan	Ukupna tržišna vrijednost stavaka u knjizi trgovanja
1	2	3
1		
2		
3		
4		
5		
6		
7		
8		
9		
10		
11		
12		
13		
14		
15		
16		
17		
18		
19		
20		
21		

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: 31.12.2012.

Valuta:	
---------	--

KATEGORIJA	KAPITALNI ZAHTJEV ZA SPECIFIČNI RIZIK	OTVORENA DUGA POZICIJA
Kategorija ovisi o izdavatelju/dužniku, vanjskom ili internom kreditnom rejtingu i preostalom roku dospeljeća	Pripadni ponder za određenu kategoriju	Svi dužnički vrijednosni papiri koje investicijsko društvo posjeduje. Duge pozicije se unose s pozitivnim predznakom.
1	2	3
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	
	0,25% (preostalo vrijeme do dospeljeća najviše 6 mjeseci)	

<p>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.</p>	UKUPNO	
	1% (preostalo vrijeme do dospjeća 6-24 m)	
	UKUPNO	
	1,6% (preostalo vrijeme do dospjeća preko 24 m)	
	UKUPNO	
<p>Dužnički financijski 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 financijski 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 financijski 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, izloženosti za koje nije dostupna kreditna procjena od priznate VIPKR.</p>	8,00%	
	UKUPNO	
<p>Dužnički financijski 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 financijski 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.</p>	12,00%	
	UKUPNO	

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

(u tisućama kuna)

OTVORENA KRATKA POZICIJA	UČINAK UMANJENJA POZICIJE RADI USLUGE PROVEDBE PONUDE, ODNOSNO PRODAJE DUŽNIČKIH FINANCIJSKIH INSTRUMENTATA UZ OBEZU OTKUPA	OTVORENA NETO DUGA POZICIJA	OTVORENA NETO KRATKA POZICIJA	UKUPNA APSOLUTNA VRIJEDNOST NETO POZICIJA	UKUPNA PONDERIRANA POZICIJA
Svi dužnički vrijednosni papiri koje je investicijsko društvo prodalo, a nije ih posjedovalo (engl. short sell). Kratke pozicije se unose 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 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.	Apsolutna vrijednost zbroja otvorene neto duge pozicije (stupac 6) i otvorene neto kratke pozicije (stupac 7) uključujući učinak umanjenja (stupac 5).	Umnožak iznosa u stupcu 8. i pripadajućeg pondera u stupcu 2. $9=8 \cdot 2$
4	5	6	7	8	9
		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 ORD: Opći rizik dužničkih financijskih instrumenata (pristup temeljen na dospjelaću)

Naziv investicijskog društva: FIMA VRJEDNOSNICE D.O.O.
MB investicijskog društva: 1418661
Oznaka izvještaja: Opći rizik dužničkih financijskih instrumenata (pristup temeljen na dospjelaću)
Datum: 31.12.2012.

Valuta:	
---------	--

ZONA	RAZRED DOSPJEĆA		PONDER (%)	OTVORENA DUGA POZICIJA	OTVORENA KRATKA POZICIJA	UČINAK UMANJENJA POZICIJE RADI USLUGE PROVEDBE PONUDE, ODNOSNO PRODAJE DUŽNIČKIH FINANCIJSKIH INSTRUMENTATA UZ OBEZU OTKUPA	OTVORENA NETO DUGA POZICIJA	
	2	3						4
Uključuje pripadne razrede dospjeća u stupcima 2. i 3.			Ponder za određeni razred dospjeća.	Duge pozicije dužničkih financijskih instrumenata se prema preostalom roku dospjeća (odnosno prema razlobju preostalom do sljedećeg određivanja kamate kod instrumenta s promjenjivom kamatnom stopom) i kamatnoj stopi raspoređuju u odgovarajuće čelije ovog stupca.	Kratke pozicije dužničkih financijskih instrumenata se prema preostalom roku dospjeća (odnosno prema razlobju preostalom do sljedećeg određivanja kamate kod instrumenta s promjenjivom kamatnom stopom) i kamatnoj stopi raspoređuju u odgovarajuće čelije ovog stupca.	Učinak umanjenja investicijskog društva računa na čin da neto poziciju izračunatu tako što iznos financijskih instrumenata za koje se bezuvjetno obvezalo prihvatiti po dogovorenoj cijeni umanj 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	8	
Zona 1	0<=1 mjeseca (kupon veći od 3%)	0<=1 mjeseca (kupon manji od 3%)	0,00					
	Ukupno						0,00	
	>1<=3 mjeseca (kupon veći od 3%)	>1<=3 mjeseca (kupon manji od 3%)	0,20					
	Ukupno							0,00
	>3<=6 mjeseca (kupon veći od 3%)	>3<=6 mjeseca (kupon manji od 3%)	0,40					
	Ukupno							0,00
Ukupno u zoni 1							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
	>2<=3 godine (kupon veći od 3%)	>1,9<=2,8 godina (kupon manji od 3%)	1,75					
	Ukupno							0,00
	>3<=4 godine (kupon veći od 3%)	>2,8<=3,6 godina (kupon manji od 3%)	2,25					
	Ukupno							0,00
Ukupno u zoni 2							0,00	
	>4<=5 godina (kupon veći od 3%)	>3,6<=4,3 godina (kupon manji od 3%)	---					

Zona 3	>3<=7 godina (kupon veći od 3%)	>4,3<=5,7 godina (kupon manji od 3%)	2,75				
	Ukupno						0,00
	>5<=7 godina (kupon veći od 3%)	>4,3<=5,7 godina (kupon manji od 3%)	3,25				
	Ukupno						0,00
	>7<=10 godina (kupon veći od 3%)	>5,7<=7,3 godina (kupon manji od 3%)	3,75				
	Ukupno						0,00
	>10<=15 godina (kupon veći od 3%)	>7,3<=9,3 godina (kupon manji od 3%)	4,50				
	Ukupno						0,00
	>15<=20 godina (kupon veći od 3%)	>9,3<=10,6 godina (kupon manji od 3%)	5,25				
	Ukupno						0,00
	>20 godina (kupon veći od 3%)	>10,6<=12,0 godina (kupon manji od 3%)	6,00				
	Ukupno						0,00
	>12,0<=20,0 godina (kupon manji od 3%)	8,00					
Ukupno						0,00	
	>20,0 godina (kupon manji od 3%)	12,50					
Ukupno						0,00	
Ukupno u zoni 3							
1.1. UKUPNO USKLADENA PONDERIRANA POZICIJA PO SVIM RAZREDIMA DOSPLJECA							
- Zbroj usklađenih ponderiranih pozicija u svim razredima dospljeća iz stupca 12.							
1.2. USKLADENA PONDERIRANA POZICIJA U ZONI 1							
- Upišujemo odgovarajući iznos iz retka "Ukupno u zoni n" stupca 15.							
1.3. USKLADENA PONDERIRANA POZICIJA U ZONI 2							
- Upišujemo odgovarajući iznos iz retka "Ukupno u zoni n" stupca 15.							
1.4. USKLADENA PONDERIRANA POZICIJA U ZONI 3							
- Upišujemo odgovarajući iznos iz retka "Ukupno u zoni n" stupca 15.							
1.5 USKLADENA PONDERIRANA POZICIJA IZMEĐU ZONE 1 I ZONE 2							
- Iznos neusklađene ponderirane duge/kratke pozicije u zoni je dan, koji je usklađen s neusklađenom ponderiranom kratkomidugom pozicijom u zoni dva smatra se usklađenom ponderiranom pozicijom između zone jedan i zone dva.							
1.6. USKLADENA PONDERIRANA POZICIJA IZMEĐU 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 IZMEĐU 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							
- Iznosi preostalih neusklađenih ponderiranih pozicija u svim zonama se izražavaju:							
1.9. KAPITALNI ZAHTEJ ZA OPĆI RIZIK DUŽNIČKIH FINANCIJSKIH 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)

OTVORENA NETO KRATKA POZICIJA	PONDERIRANA OTVORENA NETO DUGA POZICIJA	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
Iznos kratkih pozicija koji prelazi iznos dugih pozicija u istim dužni čim financijskim instrumentima.	Svaka pozicija iz stupca 8. može se s ponderom iz stupca 4. za taj razred dospjeća.	Svaka pozicija iz stupca 9. može 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 dospjeća smatra se usklađenom ponderiranom pozicijom u tom razredu dospjeća. 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 dospjeća. Ako je preostali iznos duga neusklađena 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 dospjeća. Ako je preostali iznos kratka neusklađena 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 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 pozicija kratka, njen iznos se upisuje u ovom stupcu s pozitivnim predznakom.
9	10	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	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:31.12.2012.

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 FINANIJSKIH INSTRUMENTATA UZ OBVEZU OTKUPA
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 izračunatu tako što iznos financijskih instrumenata za koje se bezuvjetno obvezalo prihvatiti po dogovorenoj cijeni umanj 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	5	6
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 ZAHTEJEV ZA OPĆI RIZIK DUŽNIČKIH FINANIJSKIH INSTRUMENTATA ZA GORNJU VALUTU (2% od 1.1 + 40% od 1.2 + 40% od 1.3 + 150% od 1.4 + 100% od 1.5)					

OTVORENA NETO DUGA POZICIJA	OTVORENA NETO KRATKA POZICIJA	PRIPADNO MODIFICIRANO TRAJANJE	OTVORENA NETO DUGA POZICIJA PONDERIRANA TRAJANJEM	OTVORENA NETO KRATKA POZICIJA PONDERIRANA TRAJANJEM	USKLAĐENA POZICIJA PONDERIRANA TRAJANJEM UNUTAR ZONE
Iznos dugih pozicija koji prelazi iznos kratkih pozicija u istim dužničkim finansijskim instrumentima.	Iznos kratkih pozicija koji prelazi iznos dugih pozicija u istim dužničkim finansijskim instrumentima.	Navodi se pripadno modificirano trajanje svakog dužničkog finansijskog instrumenta.	Jednaka je umnošku otvorene neto duge pozicije (iz stupca 7), pripadnog modificiranog trajanja (iz stupca 9) i odgovarajuće pretpostavljene promjene kamatne stope (iz stupca 3). $10=7*9*3$	Jednaka je umnošku otvorene neto kratke pozicije (iz stupca 8), pripadnog modificiranog trajanja (iz stupca 9) i odgovarajuće pretpostavljene promjene kamatne stope (iz stupca 3). $10=8*9*3$	Iznos zbroja svih dugih pozicija ponderiranih trajanjem (iznos retka "Ukupno u zoni n" u stupcu 10) koji je usklađen sa zbrojem svih kratkih pozicija ponderiranih trajanjem u istoj zoni (iznos retka "Ukupno u zoni n" u stupcu 11) smatra se usklađenom pozicijom ponderiranom trajanjem za tu zonu.
7	8	9	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

(u tisućama kuna)

PREOSTALA NEUSKLAĐENA DUGA POZICIJA PONDERIRANA TRAJANJEM UNUTAR ZONE	PREOSTALA NEUSKLAĐENA KRATKA POZICIJA PONDERIRANA TRAJANJEM UNUTAR ZONE
Preostali iznos, nakon usklađivanja pozicija ponderiranih trajanjem unutar zone (u stupcu 12), smatra se neusklađenom (dugom ili kratkom) pozicijom ponderiranom trajanjem za tu zonu. Ako je takva neusklađena ponderirana pozicija duga, njen iznos se upisuje u ovom stupcu.	Preostali iznos, nakon usklađivanja pozicija ponderiranih trajanjem unutar zone (u stupcu 12), smatra se neusklađenom (dugom ili kratkom) pozicijom ponderiranom trajanjem za tu zonu. Ako je takva neusklađena ponderirana pozicija kratka, njen iznos se upisuje u ovom stupcu.
13	14
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:31.12.2012.

(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 VRUJEDNOSNICE D.O.O.
MB investicijskog društva: 1418661
Oznaka izvještaja: Specifični i opći pozicijski rizik vlasničkih financijskih instrumenata
Datum: 31.12.2012.

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

VRSTA	OTVORENA DUGA POZICIJA	OTVORENA KRATKA POZICIJA
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.
1	2	3
(1) Dionice	0	0
(2) Potvrde o deponiranim dionicama	0	0
(3) Burzovni indeksi	0	0
(4) Zamjenjivi vrijednosni papiri	0	0

(5) Vlasnički finansijski instrumenti nastali raščlanjivanjem izvedenih finansijskih instrumenata	0	0
(6) Ostali oblici vlasničkih finansijskih instrumenata	0	0
1.1 UKUPNO UVRŠTENOM NA GORE NAVEDENO NACIONALNO TRŽIŠTE		
1.2 UKUPNI KAPITALNI ZAHTEJ ZA SPECIFIČNI I OPĆI RIZIK VLASNIČKIH FINANSIJSKIH INSTRUMENTATA ZA GORE NAVEDENO NACIONALNO TRŽIŠTE <small>- 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 finansijskih instrumenata je zbroj ta dva kapitalna zahtjeva =4%*7+8%*8</small>		

(u tisućama kuna)

UČINAK UMANJENJA POZICIJE RADI USLUGE PROVEDBE PONUDE, ODNOSNO PRODAJE VLASNIČKIH FINANCIJSKIH INSTRUMENTATA UZ OBVEZU OTKUPA	OTVORENA NETO DUGA POZICIJA	OTVORENA NETO KRATKA POZICIJA	UKUPNA BRUTO POZICIJA	UKUPNA NETO POZICIJA	KAPITALNI ZAHTJEV
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 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 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.
4	5	6	7	8	9
0	0	0			
0	0	0			
0	0	0			
0	0	0			

0	0	0			
0	0	0			
	0	0	0	0	
					0

Obrazac VR: Valutni rizik

Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O.
MB investicijskog društva: 1418661
Oznaka izvještaja: Valutni rizik
Datum:31.12.2012.

VALUTA	"SPOT" POZICIJA		"FORWARD" POZICIJA	
	IMOVINA	OBVEZE	DUGA POZICIJA	KRATKA POZICIJA
Unosi se oznaka valute.	Sva devizna imovina i obveze, imovina i obveze uz valutnu klauzulu, "spot" transakcije kupnje i prodaje deviza koje su ugovorene, ali nisu bilančno uknjižene, "spot" pozicije valutnih "swap" ugovora. Imovina se upisuje s pozitivnim predznakom, a obveze s negativnim predznakom.		"Forward" transakcije kupnje i prodaje deviza, uključujući i "futures" ugovore na tu valutu, te glavnice valutnih "swap" ugovora koja nije uključena u "spot" poziciju, neopozive garancije, nepokriveni akreditivi i slični instrumenti na temelju kojih će investicijsko društvo zasigurno morati izvršiti plaćanje, a postoji vjerojatnost da ta sredstva investicijsko društvo neće moći nadoknaditi (iskazani u stranoj valuti ili uz valutnu klauzulu). Duge pozicije se upisuju s pozitivnim, a kratke s negativnim predznakom.	
1	2	3	4	5
EUR	20	-275	0	0
Ukupno				
USD	39	0	0	0
Ukupno				
RSD	71	0	0	0
Ukupno				
CAD	1	0	0	0
Ukupno				
GBP	0	0	0	0
Ukupno				

NOK	0	0	0	0
Ukupno				
BAM	0	0	0	0
Ukupno				
Pretpostavljena ulaganja subjekta za zajednička ulaganja u stranoj valuti tretirana kao zasebna valuta				
Ukupno				

1.1 UKUPNA NETO DUGA DEVIZNA POZICIJA - Duge neto pozicije u pojedinim valutama zbrajaju se odvojeno, a zbroj nosi pozitivan predznak (+).	109,65
1.2 UKUPNA NETO KRATKA DEVIZNA POZICIJA - Kratke neto pozicije u pojedinim valutama zbrajaju se odvojeno, a zbroj nosi negativan predznak (-).	-254,53
1.3 UKUPNA NETO OTVORENA DEVIZNA POZICIJA - Veći iznos po apsolutnoj vrijednosti od iznosa upisanih u retcima 1.1 i 1.2 (=MAX(1.1,ABS(1.2)))	254,53
1.4 KAPITALNI ZAHTJEV ZA VALUTNI RIZIK - Ukupnu neto otvorenu deviznu poziciju pomnožiti sa 8% (=1.3*8%)	20,36

POZICIJE U VALUTNIM OPCIJAMA		STAVKE POZICIJA IMOVINE I OBEVEZA S UGRAĐENOM "CALL" OPCIJOM		TRŽIŠNA VRIJEDNOST
Investicijsko društvo izračunava vrijednost knjige valutnih opcija za svaku valutu. Pri izračunu vrijednosti knjige valutnih opcija, opcije se uključuju u delta ekvivalentu nominalne vrijednosti opcije.		Imovina i obveze s ugrađenom "call" opcijom zbrajaju se u njihovom nominalnom iznosu vodeći računa o predznaku koji nose.		Upisuje se tržišna vrijednost svake druge opcije (koja stranoj
DUGA POZICIJA	KRATKA POZICIJA	IMOVINA	OBEVEZE	DUGA POZICIJA
6	7	8	9	10
0	0	0	0	0
0	0	0	0	0
0	0	0	0	0
0	0	0	0	0
0	0	0	0	0

0	0	0	0	0
0	0	0	0	0

(u tisućama kuna)

ST OSTALIH OPCIJA	NETO OTVORENA DEVIZNA POZICIJA		UKUPNA NETO OTVORENA DEVIZNA POZICIJA U POJEDNOJ VALUTI
nije valutna) kod koje je temeljna varijabla iskazana u valuti.	Upisuje se neto "spot" pozicija, neto "forward" pozicija, neto delta ekvivalent ukupne knjige valutnih opcija, neto pozicije imovina i obveza s ugrađenom "call" opcijom, te tržišna vrijednost bilo koje druge opcije (koja se ne odnosi na zamjenu valuta).		Upisuje se ukupna neto otvorena pozicija u pojedinoj valuti.
KRATKA POZICIJA	DUGA POZICIJA	KRATKA POZICIJA	
11	12	13	14
0	20	-275	
	20,11	-274,63	-254,53
0	39	0	
	38,52	0,00	38,52
0	71	0	
	70,90	-0,27	70,63
0	0,5027	0	
	0,50	0,00	0,50
0	0	0	
	0,00	0,00	0,00

0			
	0,00	0,00	0,00
0			
	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:31.12.2012.

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 ZAHTJEV ZA ROBNİ 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: 31.12.2012.

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 OPCJE KOD DELTA-PLUS METODE	0,00

2. JEDNOSTAVNA METODA					
VRSTA POZICIJE	OPIS	JEDNOZNAČNA OZNAKA POSLA	TRŽIŠNA VRIJEDNOST TEMELJNE VARIJABLE POMNOŽENA PRIPADAJUĆIM FAKTOROM	TRŽIŠNA VRIJEDNOST OPCJE (IZNOS "IN THE MONEY")	KAPITALNI ZAHTEJEV
	Unosi se opis vrste opcije npr. call/put/čiorica, 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
2.2 UKUPNO					0,00
2.3 UKUPNI KAPITALNI ZAHTEJ ZA OPCJE KOD JEDNOSTAVNE METODE					0,00

Obrazac RRLD: Robni rizik (pristup ljestvice dospjela)

Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O.
MB investicijskog društva: 1418661
Oznaka izvještaja: Robni rizik (pristup ljestvice dospjeća)
Datum: 31.12.2012.

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 VRIJEDNOST NETO OTVORENE DUGE POZICIJE	TRŽIŠNA VRIJEDNOST 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 <small>- Iznos neusklađene duge/kratke pozicije u određenom razredu dospjeća koji je usklađen s neusklađenom kratkom/dugom pozicijom u sljedećem razredu dospjeća smatra se usklađenom pozicijom između ta dva razreda dospjeća.</small>						
1.2 Neusklađena pozicija između razreda 1 i 2 <small>- Preostali iznos nakon usklađivanja pozicija između razreda 1 i 2 smatra se (dugom ili kratkom) neusklađenom pozicijom između ta dva razreda dospjeća.</small>						
1.3 Usklađenje 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 Usklađenje 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 Usklađenje 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 Usklađenje 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 Usklađenje 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 <small>- Zbroj apsolutnih iznosa usklađenih dugih i kratkih pozicija unutar svih razreda dospjeća.</small>						
1.14 Zbroj neusklađenih pozicija unutar razreda i između razreda <small>- Zbroj apsolutnog iznosa neusklađene pozicije unutar jednog razreda dospjeća, odnosno između dva razreda dospjeća koji se prenosi u sljedeći razred dospjeća.</small>						
1.15 Preostala neusklađena pozicija <small>- Apsolutni iznos preostale neusklađene pozicije.</small>						
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 dospjeća smatra se usklađenom pozicijom u tom razredu dospjeća i upisuje se s pozitivnim predznakom.	Preostali iznos, nakon usklađenja pozicija unutar razreda, smatra se dugom/kratkom neusklađenom pozicijom za taj razred dospjeća. 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 dospjeća. 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

Obrazac RN: Rizik namire

Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O.
MB investicijskog društva: 1418661
Oznaka izvještaja: Rizik namire
Datum: 31.12.2012.

(u tisućama kuna)

BROJ DANA KAŠNJENJA	VRSTA INSTRUMENTA NA KOJU SE TRANSAKCIJA ODNOSI	UGOVORENA CIJENA	TEKUĆA TRŽIŠNA VRIJEDNOST	RAZLIKA	KAPITALNI ZAHTJEV
Broj radnih dana nakon datuma isporuke ili datuma predviđenog 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 (iznosa u stupcu 3) i tržišne vrijednosti financijskog instrumenta (iznosa u stupcu 4) ukoliko je nepovoljna za investicijsko društvo. Ako ta razlika znači 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
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
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
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
1.1 UKUPNI KAPITALNI ZAHTJEV 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: 31.12.2012.

(u tisućama kuna)

VRSTA PREKORAČENJA IZLOŽENOSTI	UKUPNI IZNOS PREKORAČENJA	KAPITALNI ZAHTEJ ZA POZICIJE U KNJIZI TRGOVANJA	UKUPNI KAPITALNI ZAHTEJEV
	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 ZAHTEJEV ZA RIZIK PREKORAČENJA NAJVEĆIH DOPUŠTENIH IZLOŽENOSTI			0,00

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

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
Datum:31.12.2012.

(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:31.12.2012.

OSNOVNI PODACI					
REGULATORNI VaR			INTERNI VaR		
OZNAKA INSTRUMENTA ZA REGULATORNI MODEL	OZNAKA IZRAČUNA ZA SPECIFIČNI RIZIK VLASNIČKIH FINANCIJSKIH INSTRUMENATA	OZNAKA IZRAČUNA ZA SPECIFIČNI RIZIK DUŽNIČKIH FINANCIJSKIH INSTRUMENATA	OZNAKA PROMJENE VRIJEDNOSTI PORTFELJA ZA IZRAČUN BROJA PREKORAČENJA	JEDNOSTRANI INTERVAL POUZDANOSTI INTERNOG VaR-a (a)	RAZDOBLJE DRŽANJA INTERNOG VaR-a (b)
1	2	3	4	5	6

(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 izra čunati prema standardiziranom pristupu

Naziv investicijskog društva: FIMA VRJEDNOSNICE D.O.O.
MB investicijskog društva: 1418661
Oznaka izvještaja: KRSP, potraživanja ili potencijalna potraživanja od središnje države ili središnjih banaka,
Datum: 31.12.2012.

	BRUTO IZLOŽENOST		(-) ISPRAVCI VRJEDNOSTI REZERVACIJE	4=1+3	TEHNIKE UMANJENJA KREDITNOG RIZIKA - EFEKTI ZAMIJENE NA IZLOŽENOST				
	1	2			NEMATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA: PRLAGODENE VRJEDNOSTI (GA)		MATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA		EFEKTI ZA (-) UKUPNI ODNOS
					GARANCIE	KREDITNE IZVEDENICE	JEDNOSTAVNA METODA FINANCUSKOG KOLATERALA	OSTALI INSTRUMENTI MATERIJALNE ZAŠTITE	
UKUPNA IZLOŽENOST	117,76	0,00	0,00	117,76					
RASPOREĐIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI S OBZIROM NA VRSTU IZLOŽENOSTI									
Bilančne stavke	117,76		0,00	117,76					
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%	117,76	0,00	0,00	117,76					
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 VPKR ili AKI	117,76	0,00	0,00	117,76					
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%	0,00	0,00	0,00	0,00					
od čega: bez procjene priznate VPKR 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 izra čunati prema standardiziranom pristupu

Naziv investicijskog društva: FIMA VRJEDNOSNICE D.O.O.
MB investicijskog društva: 1418661
Oznaka izvještaja: KRSP, potraživanja ili potencijalna potraživanja od institucija
Datum: 31.12.2012.

	BRUTO IZLOŽENOST		(-) ISPRAVCI VRIJEDNOSTI I REZERVACIJE	4=1+3	TEHNIKE UMANJENJA KREDITNOG RIZIKA - EFEKTI ZAMJENE NA IZLOŽENOST					
	1	2			NEMATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA: PRILAGODENE VRIJEDNOSTI (GA)		MATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA		EFEKTI ZAMJENE	
					GARANCIJE	KREDITNE IZVEDENICE	JEDNOSTAVNA METODA FINANCUSKOG KOLATERALA	OSTALI INSTRUMENTI MATERIJALNE ZAŠTITE	(-) UKUPNI ODNOS	(+) UKUPNI DONOS
3	4=1+3	5	6	7	8	9	10			
UKUPNA IZLOŽENOST	-	0,00	0,00	-						
RASPOREĐIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI S OBZIROM NA VRSTU IZLOŽENOSTI										
Bilančne stavke	-		0,00	-						
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%	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%	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 izra čunati prema standardiziranom pristupu

Naziv investicijskog društva: FIMA VRJEDNOSNICE D.O.O.
MB investicijskog društva: 1418661
Oznaka izvještaja: KRSP, potraživanja ili potencijalna potraživanja od trgovačkih društava
Datum: 31.12.2012.

	BRUTO IZLOŽENOST		(-) ISPRAVCI VRJEDNOSTI I REZERVACIJE	4=1+3	TEHNIKE UMANJENJA KREDITNOG RIZIKA - EFEKTI ZAMJENE NA IZLOŽENOST					
	1	2			NEMATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA: PRILAGODENE VRJEDNOSTI (GA)		MATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA		EFEKTI ZAMJENE NA IZLOŽENOST	
					GARANCIJE	KREDITNE IZVEDENICE	JEDNOSTAVNA METODA FINANCUSKOG KOLATERALA	OSTALI INSTRUMENTI MATERIJALNE ZAŠTITE		(-) UKUPNI ODNOS
UKUPNA IZLOŽENOST	3.873,53	0,00	0,00	3.873,53						
RASPOREĐIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI S OBZIROM NA VRSTU IZLOŽENOSTI										
Bilancijske stavke	3.873,53		0,00	3.873,53						
Izvanbilancijske 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%	3.873,53	0,00	0,00	3.873,53						
od čega: bez procjene priznate VIPKR ili AKI	3.873,53	0,00	0,00	3.873,53						
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 stanovništva
Datum: 31.12.2012.

	BRUTO IZLOŽENOST		(-) ISPRAVCI VRIJEDNOSTI I REZERVACIJE	4=1+3	TEHNIKE UMANJENJA KREDITNOG RIZIKA - EFEKTI ZAMJENE NA IZLOŽENOST					
	1	2 PROIŠAŠLO IZ DRUGE UGOVORNE STRANE			NEMATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA: PRILAGOĐENE VRIJEDNOSTI (GA)		MATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA		EFEKTI ZAMJENE	
					GARANCIJE	KREDITNE IZVEDENCE	JEDNOSTAVNA METODA FINANCIJSKOG KOLATERALA	OSTALI INSTRUMENTI MATERIJALNE ZAŠTITE	(-) UKUPNI ODNOS	(+) UKUPNI DONOS
UKUPNA IZLOŽENOST	0,60	0,00	0,00	0,60						
RASPOREĐIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI S OBIROM NA VRSTU IZLOŽENOSTI										
Bilančne stavke	0,60		0,00	0,60						
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%	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%	0,60	0,00	0,00	0,60						
100%	0,00	0,00	0,00	0,00						
od čega: bez procjene priznate VIPKR ili AKI	0,60	0,00	0,00	0,60						
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 izra čunati prema standardiziranom pristupu

Naziv investicijskog društva: FIMA VRJEDNOSNICE D.O.O.
MB investicijskog društva: 1418661
Oznaka izvještaja: KRSP, dospjela nenaplaćena potraživanja
Datum: 31.12.2012.

	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 KONVERZUSKIH FAKTORA
	1	2 PROZAŠLO IZ DRUGE UGOVORNE STRANE			NEMATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA: PRILAGOĐENE VRJEDNOSTI (GA)		MATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA		EFEKTI ZAMJENE		
					GARANCIE	KREDITNE IZVEDENICE	JEDNOSTAVNA METODA FINANCUSKOG KOLATERALA	OSTALI INSTRUMENTI MATERIJALNE ZAŠTITE	(-) UKUPNI ODNOS	(+) UKUPNI DONOS	
11=4+9+10											
UKUPNA IZLOŽENOST	119.13	0.00	0.00	119.13							119.13
RASPOREDIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI S OBLIROM NA VRSTU IZLOŽENOSTI											
Bilancične stavke	119.13		0.00	119.13							119.13
Izvanbilancične 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 netiranju 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%	119.13	0.00	0.00	119.13							
od čega: dospjela nenaplaćena potraživanja	119.13	0.00	0.00	119.13							
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 izra čunati 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: 31.12.2012.

	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 KONVERZUSKIH FAKTORA
	1	2 PROZAŠLO IZ DRUGE UGOVORNE STRANE			NEMATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA: PRILAGOĐENE VRJEDNOSTI (GA)		MATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA		EFEKTI ZAMJENE		
					GARANCIJE	KREDITNE IZVEDENICE	JEDNOSTAVNA METODA FINANCUSKOG KOLATERALA	OSTALI INSTRUMENTI MATERIJALNE ZAŠTITE	(-) UKUPNI ODNOS	(+) UKUPNI DONOS	
11=4+9+10											
UKUPNA IZLOŽENOST	979,18	0,00	0,00	979,18							979,18
RASPOREDIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI S OBRZOM NA VRSTU IZLOŽENOSTI											
Bilančne stavke	260,68		0,00	260,68							260,68
Izvanbilančne stavke	718,50		0,00	718,50							718,50
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 netiranju 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%	718,50	0,00	0,00	718,50							
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	718,50	0,00	0,00	718,50							
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%	260,68	0,00	0,00	260,68							
od čega: bez procjene priznate VIPKR ili AKI	260,68	0,00	0,00	260,68							
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 izra čunati prema standardiziranom pristupu

Naziv investicijskog društva: FIMA VRJEDNOSNICE D.O.O.
MB investicijskog društva: 1418661
Oznaka izvještaja: KRSP; ostale stavke
Datum: 31.12.2012.

	BRUTO IZLOŽENOST		(-) ISPRAVCI VRIJEDNOSTI REZERVACIJE	4=1+3	TEHNIKE UMANJENJA KREDITNOG RIZIKA - EFEKTI ZAMJENE NA IZLOŽENOST				
	1	2			NEMATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA: PRILAGOĐENE VRIJEDNOSTI (GA)		MATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA		(-) UKUPNI ODNOS
					GARANCIJE	KREDITNE IZVEDENICE	JEDNOSTAVNA METODA FINANCUSKOG KOLATERALA	OSTALI INSTRUMENTI MATERIJALNE ZAŠTITE	
5	6	7	8	9					
UKUPNA IZLOŽENOST	1.927,88	0,00	0,00	1.927,88					
RASPOREĐIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI S OBZIROM NA VRSTU IZLOŽENOSTI									
Bilančne stavke	1.927,88		0,00	1.927,88					
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%	9,57	0,00	0,00	9,57					
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 VPKR ili AKI	9,57	0,00	0,00	9,57					
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%	1.918,31	0,00	0,00	1.918,31					
od čega: bez procjene priznate VPKR ili AKI	1.918,31	0,00	0,00	1.918,31					
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:31.12.2012.

I. POSLOVI INVESTICIJSKOG DRUŠTVA	II. RELEVANTNI POKAZATELJI			III. KAPITALNI ZAHTJEV	PREMA METODOLOGIJI ZA MEĐUSOBNU PODJELU KAPITALNIH ZAHTJEVA	IV. ELEMENT KAPITALNI ZAHTJEV PRIJE SMANJENJA ZBOG OČEKIVANOG GUBITKA OBUHVAĆENOG POSLOVNIM PRAKSAMA I/ILI ZBOG UZIMANJA U OBZIR UČINAKA OSIGURANJA I DRUGIH MEHANIZAMA ZA PRIJENOS RIZIKA			
	POSLOVNA GODINA (2009)	POSLOVNA GODINA (2010)	POSLOVNA GODINA (2011)				4	5	6=4+7+8
	1	2	3				4	5	6=4+7+8
A - JEDNOSTAVNI PRISTUP	5.788	3.135	2.507	572					
B - STANDARDIZIRANI PRISTUP									
POSLOVNE LINIJE:									
KORPORATIVNO FINANCIRANJE									
TRGOVNJE I PRODAJA									
PRUŽANJE INVESTICIJSKIH USLUGA									
MALOM ULAGATELJU									
PLAĆANJA I NAMIRE									
AGENCIJSKE USLUGE									
UPRAVLJANJE IMOVINOM									
C - NAPREDNI PRISTUP									

(u tisućama kuna)

TI 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

Obrazac OPR-DET: Bruto gubici po poslovnim linijama i vrstama događaja

Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O.
MB investicijskog društva: 1418661
Oznaka izvještaja: Bruto gubici po poslovnim linijama i vrstama događaja
Datum:31.12.2012.

I. RASPORED GUBITAKA PO POSLOVNIM LINIJAMA		II. VRSTE ŠTETNIH DOGAĐAJA							III. UKUPNO PO VRSTAMA DOGAĐAJA	IV. PRAG KOJI SE PRIMJENJUJE ZA SKUPLJANJE PODATAKA	
		INTERNA PRIJEVARA	EKSTERNA PRIJEVARA	ODNOSI SA ZAPOSLENICIMA I SIGURNOST NA RADNOM	KLJENTI, PROIZVODI I POSLOVNI POSTUPCI	ŠTETA NA MATERIJALNOJ IMOVINI	PREKIDI I NARUŠAVANJA RADA IT SUSTAVA	IZVRŠENJE, ISPORUKA I UPRAVLJANJE PROCESIMA		NAJNIŽI PRAG	NAJVIŠI PRAG
		1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
1. KORPORATIVNO FINANCIRANJE	Broj događaja										
	Ukupan iznos gubitka										
	Naveći pojedinačni gubitak										
2. TRGOVANJE I PRODAJA	Broj događaja										
	Ukupan iznos gubitka										
	Naveći pojedinačni gubitak										
3. PRUŽANJE INVESTICIJSKIH USLUGA MALOM ULAGATELJU	Broj događaja										
	Ukupan iznos gubitka										
	Naveći pojedinačni gubitak										
4. PLAĆANJE I NAMIRE	Broj događaja										
	Ukupan iznos gubitka										
	Naveći pojedinačni gubitak										
5. AGENCIJSKE USLUGE	Broj događaja										
	Ukupan iznos gubitka										
	Naveći pojedinačni gubitak										
6. UPRAVLJANJE IMOVINOM	Broj događaja										
	Ukupan iznos gubitka										
	Naveći pojedinačni gubitak										
7. UKUPNO PO POSLOVNIM LINIJAMA	Broj događaja										
	Ukupan iznos gubitka										
	Naveći pojedinačni gubitak										

(u tisućama kuna)