

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 2011.

Obrazac K: Kapital

| |
|---|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: K: Kapital |
| Datum:31.12.2011. |

| Oznaka pozicije | STAVKA | IZNOS (u tisućama kuna) |
|-----------------|--|----------------------------|
| 1. | KAPITAL | 6.441 |
| 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 | -785 |
| 1.1.12. | Gubitak tekuće godine | -608 |
| 1.1.12.1. | <i>na osnovu godišnjeg financijskog izvještaja</i> | |
| 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.) | -1.393 |
| 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 | 4.907 |
| 1.2. | Izračun dopunskog kapitala I | |
| 1.2.1. | Posebne rezerve | 2.123 |
| 1.2.1.1. | <i>dugotrajne materijalne imovine</i> | 1.407 |
| 1.2.1.2. | <i>dugotrajne financijske imovine</i> | 716 |
| 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.) | 2.123 |
| 1.2.8. | Dopunski kapital I iznad ograničenja | 0 |

| | | |
|---------------|---|--------------|
| B. | DOPUNSKI KAPITAL I | 2.123 |
| 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 | -589 |
| 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) | -589 |
| 1.4.8. | Odbitne stavke na teret osnovnog kapitala | -295 |
| 1.4.8.1. | 50% ukupnog iznosa odbitnih stavki kapitala | -295 |
| 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 | -295 |
| 1.4.9.1. | 50% ukupnog iznosa odbitnih stavki kapitala | -295 |
| D. | ODBITNE STAVKE KAPITALA | -589 |
| 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: 31.12.2011. |

| Oznaka pozicije | STAVKA | IZNOS (u tisućama kuna) | POKRIVENOST OSNOVNIM KAPITALOM | POKRIVENOST DOPUNSKIM KAPITALOM I | POKRIVENOST DOPUNSKIM KAPITALOM II |
|-----------------|---|--|-----------------------------------|--------------------------------------|---------------------------------------|
| 1. | KAPITAL | 6.441 | | | |
| A. | OSNOVNI KAPITAL | 4.907 | | | |
| B. | DOPUNSKI KAPITAL I | 2.123 | | | |
| C. | DOPUNSKI KAPITAL II | 0 | | | |
| 2. | KAPITALNI ZAHTEVI | 1.481 | | | |
| 2.1. | Izračun kapitalnih zahtjeva za kreditni rizik, rizik druge ugovorne strane i rizik slobodnih isporuka | | | | |
| 2.1.1. | Standardizirani pristup | 608 | | | |
| 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 | 398 | | | |
| 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 | 11 | | | |
| 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 | 37 | | | |
| 2.1.1.1.a.14. | Potraživanja u obliku ulaganja u subjekte za zajednička ulaganja | 0 | | | |
| 2.1.1.1.a.15. | Ostale izloženosti | 161 | | | |
| F. | KAPITALNI ZAHTEV ZA KREDITNI RIZIK, RIZIK DRUGE UGOVORNE STRANE I RIZIK SLOBODNE ISPORUKE | 608 | 608 | 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 | 41 | 41 | 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 | 41 | 41 | 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 ZAHTEV ZA POZICIJSKI RIZIK, VALUTNI RIZIK I ROJNI RIZIK | 41 | 41 | 0 | 0 |

| | | | | | |
|----------|--|-------|-----|---|---|
| 2.4. | Izračun kapitalnog zahtjeva za operativni rizik | | | | |
| 2.4.1. | Jednostavni pristup | 832 | 832 | 0 | |
| 2.4.2. | Standardizirani pristup | 0 | 0 | 0 | |
| 2.4.3. | Napredni pristup | 0 | 0 | 0 | |
| I. | KAPITALNI ZAHTJEV ZA OPERATIVNI RIZIK | 832 | 832 | 0 | |
| 2.5. | Izračun kapitalnog zahtjeva prema članku 177. ZTK (1/4 općih troškova iz prethodne poslovne godine) | | | | |
| J. | KAPITALNI ZAHTJEV 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 | 4.960 | | | |
| 2.7.1.a. | Adekvatnost kapitala izuzimajući kapitalni zahtjev za rizik prekoračenja dopuštenih izloženosti | 4,35 | | | |
| 2.8. | Višak (+)/manjak (-) kapitala | 441 | | | |
| 2.8.a. | Adekvatnost kapitala | 4,35 | | | |
| 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:31.12.2011.

Sastavio:

Martina Colarić, Risk manager

Telefonski broj: 042/660-976

Žig i potpis odgovorne osobe:

Snježana Mihinjač Horvat, predsjednik Uprave

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

| GRUPA INVESTICIJSKOG DRUŠTVA U RH | | | | | | | |
|-----------------------------------|--------------|---|-----------------------------------|---|---------------------------------------|--|--------------------|
| 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 |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 |
| | | | | | | | |

Datum:31.12.2011.

Sastavio:

Martina Colarić, Risk manager

Telefonski broj: 042/660-976

Žig i potpis odgovorne osobe:

Snježana Mihinjač Horvat, predsjednik Uprave

(u tisućama kuna)

| KAPITAL | OD ČEGA: OSNOVNI KAPITAL | VIŠAK (+)/MANJAK(-) KAPITALA | VIŠAK (+)/MANJAK(-) KAPITALA UZEVŠI U OBZIR NADZORNE MJERE |
|---------|-----------------------------|---------------------------------|---|
| 9 | 10 | 11=9-8 | 12 |
| | | | |

| | | | | | | | | |
|---|--------|--|--|---|------|------|------|------|
| 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 prodaje 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:31.12.2011. |

(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 VRJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: SR: Specifični rizik dužničkih financijskih instrumenata |
| Datum: 31.12.2011. |

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

| KATEGORIJA | KAPITALNI ZAHTJEV ZA SPECIFIČNI RIZIK | OTVORENA DUGA 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. |
| 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 dospjeća 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 dospelja 6-24 mj) | |
| | UKUPNO | |
| | 1,6% (preostalo vrijeme do dospelja preko 24 mj) | |
| <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 ZAHTJEV ZA SPECIFIČNI RIZIK DUŽNIČKIH FINANCIJSKIH INSTRUMENTATA ZA GORNJU VALUTU | 0,00 |
|--|------|

| OTVORENA KRATKA POZICIJA | UČINAK UMANJENJA POZICIJE RADI USLUGE PROVEDBE PONUDE, ODNOSNO PRODAJE DUŽNIČKIH FINACIJSKIH INSTRUMENTATA UZ OBVEZU OTKUPA | OTVORENA NETO DUGA POZICIJA | OTVORENA NETO KRATKA 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 finacijskih 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 finacijskih 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 finacijskim instrumentima. | Iznos kratkih pozicija koji prelazi iznos dugih pozicija u istim dužničkim finacijskim instrumentima. |
| 4 | 5 | 6 | 7 |
| | | | |
| | | 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)

| UKUPNA APSOLUTNA VRIJEDNOST NETO POZICIJA | UKUPNA PONDERIRANA POZICIJA |
|--|--|
| 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. $9=8*2$ |
| 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 |

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

| |
|---|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: Opći rizik dužničkih financijskih instrumenata (pristup temeljen na dospijeću) |
| Datum: 31.12.2011. |

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

| ZONA | RAZRED DOSPIJEĆA | | PONDER (%) | 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 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 kamate 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 kamate kod instrumenta s promjenjivom kamatnom stopom) i kamatnoj stopi raspoređuju u odgovarajuće ćelije ovog stupca. | Učinak umanjjenja investicijsko društvo rčuna 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 dobitnu poziciju investicijsko društvo umanjuje za faktore umanjjenja 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 | >5 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 USKLAĐENA PONDERIRANA POZICIJA PO SVIM RAZREDIMA DOSPIJEĆA | | | | | | |
| - Zbroj usklađenih ponderiranih pozicija u svim razredima dospijeće iz stupca 12. | | | | | | |
| 1.2. USKLAĐENA PONDERIRANA POZICIJA U ZONI 1 | | | | | | |
| - Upisujemo odgovarajući iznos iz retka "Ukupno u zoni" stupca 15. | | | | | | |
| 1.3. USKLAĐENA PONDERIRANA POZICIJA U ZONI 2 | | | | | | |
| - Upisujemo odgovarajući iznos iz retka "Ukupno u zoni" stupca 15. | | | | | | |
| 1.4. USKLAĐENA PONDERIRANA POZICIJA U ZONI 3 | | | | | | |
| - Upisujemo odgovarajući iznos iz retka "Ukupno u zoni" stupca 15. | | | | | | |
| 1.5. USKLAĐENA PONDERIRANA POZICIJA IZMEĐU ZONE 1 I ZONE 2 | | | | | | |
| - Iznos neusklađene ponderirane dugotrajne pozicije u zoni jedan, koji je usklađen s neusklađenom ponderiranom kratkomdugom pozicijom u zoni dva smatra se usklađenom ponderiranom pozicijom između zone jedan i zone dva. | | | | | | |
| 1.6. USKLAĐENA 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. USKLAĐENA 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 NEUSKLAĐENA PONDERIRANA POZICIJA | | | | | | |
| - Iznosi preostalih neusklađenih ponderiranih pozicija u svim zonama se zbrajaju. | | | | | | |
| 1.9. KAPITALNI ZAHTEJ ZA OPĆI RIZIK DUŽNIČKIH FINANCIJSKIH INSTRUMENATA 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) | | | | | | |

| 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 |
|--|--|--|---|---|---|--|--|
| Iznos kratkih pozicija koji prelazi iznos dugih pozicija u istim dužničkim finansijskim instrumentima. | Svaka pozicija iz stupca 8, množi se s ponderom iz stupca 4, za taj razred dospjeća. | 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 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 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 dospjeća. 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" stupca 13) koji je usklađen sa zbrojem svih kratkih neusklađenih ponderiranih pozicija u istoj zoni (iznos ukupne sume iz retka "Ukupno u zoni" 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. |
| 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | 16 |
| | | | | | | | |
| 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 |

(u tisućama kuna)

| PREOSTALA NEUSKLAĐENA PONDERIRANA KRATKA POZICIJA UNUTAR ZONE |
|---|
| Preostali iznos, nakon usklađivanja ponderiranih pozicija unutar zone (u stupcu 15), smatra se (dugoro ili kratkom) neusklađenom ponderiranom pozicijom te zone. Ako je takva neusklađena ponderirana pozicija kratka, njen iznos se upisuje u ovom stupcu s pozitivnim predznakom. |
| 17 |
| |
| |
| |
| |
| |
| |
| |
| 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:31.12.2011. |

| | |
|---------|--|
| 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 |
|--|------------------------------------|--|---|--|---|
| 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 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.). |
| 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:31.12.2011. |

(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: 31.12.2011. |

| | |
|---|---|
| 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 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:31.12.2011. |

| 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 | 1 | 393 | 0 | 0 |
| Ukupno | | | | |
| USD | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ukupno | | | | |
| RSD | 114 | 0 | 0 | 0 |
| Ukupno | | | | |
| BAM | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ukupno | | | | |
| NOK | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Ukupno | | | | |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | |
| Ukupno | | | | |
| | | | | |
| 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 (+). | 508,18 |
| 1.2 UKUPNA NETO KRATKA DEVIZNA POZICIJA - Kratke neto pozicije u pojedinim valutama zbrajaju se odvojeno, a zbroj nosi negativan predznak (-). | 0,00 |
| 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))) | 508,18 |
| 1.4 KAPITALNI ZAHTJEV ZA VALUTNI RIZIK - Ukupnu neto otvorenu deviznu poziciju pomnožiti sa 8% (=1.3*8%) | 40,65 |

| POZICIJE U VALUTNIM OPCIJAMA | | STAVKE POZICIJA IMOVINE I OBEVA 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 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | |
| | | | | |
| | | | | |
| | | | | |
| | | | | |
| | | | | |

(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 | 1 | 393 | |
| | 1,21 | 392,82 | 394,03 |
| 0 | 0 | 0 | |
| | 0,41 | 0,00 | 0,41 |
| 0 | 114 | 0 | |
| | 114,12 | -0,38 | 113,74 |
| 0 | 0 | 0 | |
| | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 0 | 0 | 0 | |
| | 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:31.12.2011. |

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

| | OTVORENA DUGA POZICIJA | OTVORENA KRATKA POZICIJA | NETO POZICIJA | TRŽIŠNA VRIJEDNOST NETO 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 (-). | 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 ROBNi 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: 31.12.2011. |

| 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 dospjeća)

| |
|---|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: Robni rizik (pristup ljestvice dospjeća) |
| Datum: 31.12.2011. |

| | |
|-----------------------------|--|
| 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 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 - 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 dospjeća smatra se usklađenom pozicijom u tom razredu dospjeća i upisuje se s pozitivnim predznakom. | Preostali iznos, nakon usklađivanja 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 usklađivanja 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 |

| | | |
|------|--|--|
| 0.00 | | |
|------|--|--|

Obrazac RN: Rizik namire

| |
|---|
| Naziv investicijskog društva: FIMA VRIJEDNOSNICE D.O.O. |
| MB investicijskog društva: 1418661 |
| Oznaka izvještaja: Rizik namire |
| Datum: 31.12.2011. |

(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: 31.12.2011. |

(u tisućama kuna)

| VRSTA PREKORAČENJA IZLOŽENOSTI | UKUPNI IZNOS PREKORAČENJA | KAPITALNI ZAHTEJ ZA POZICIJE U KNJIZI TRGOVANJA | UKUPNI KAPITALNI ZAHTEJ |
|--|--|--|---|
| | 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 ZAHTEJ 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:31.12.2011. |

(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:31.12.2011. |

| 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: 31.12.2011. |

| | BRUTO IZLOŽENOST | | (-) ISPRAVCI VRJEDNOSTI REZERVACIJE | 4=1+3 | TEHNIKE UMANJENJA KREDITNOG RIZIKA - EFEKTI ZAMIJENE NA IZLOŽENOST | | | | |
|---|------------------|------|-------------------------------------|--------|--|---------------------|---|--|------------------|
| | 1 | 2 | | | NEMATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA: PRLAGOĐENE VRJEDNOSTI (GA) | | MATERIJALNA KREDITNA ZAŠTITA | | EFEKTI ZA |
| | | | | | GARANCUE | KREDITNE IZVEDENICE | JEDNOSTAVNA METODA FINANCUSKOG KOLATERALA | OSTALI INSTRUMENTI MATERIJALNE ZAŠTITE | (-) UKUPNI ODNOS |
| | | | | | | | | | |
| UKUPNA IZLOŽENOST | 130,66 | 0,00 | 0,00 | 130,66 | | | | | |
| RASPOREĐIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI S OBZIROM NA VRSTU IZLOŽENOSTI | | | | | | | | | |
| Bilančne stavke | 130,66 | | 0,00 | 130,66 | | | | | |
| 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% | 130,66 | 0,00 | 0,00 | 130,66 | | | | | |
| 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 | 130,66 | 0,00 | 0,00 | 130,66 | | | | | |
| 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 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: 31.12.2011. |

| | 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 | |
| | | | | | GARANCIJE | KREDITNE IZVEDENICE | JEDNOSTAVNA METODA FINANCUSKOG KOLATERALA | OSTALI INSTRUMENTI MATERIJALNE ZAŠTITE | (-) UKUPNI ODNOS | (+) UKUPNI DONOS |
| | | | | | | | | | | |
| 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: 31.12.2011. |

| | 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 |
| | | | | | GARANCIE | KREDITNE IZVEDENICE | JEDNOSTAVNA METODA FINANCUSKOG KOLATERALA | OSTALI INSTRUMENTI MATERIJALNE ZAŠTITE | |
| | | | | | | | | | |
| 3 | 4=1+3 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | | | |
| UKUPNA IZLOŽENOST | 4.969,68 | 0,00 | 0,00 | 4.969,68 | | | | | |
| RASPOREĐIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI S OBZIROM NA VRSTU IZLOŽENOSTI | | | | | | | | | |
| Bilancijske stavke | 4.969,68 | | 0,00 | 4.969,68 | | | | | |
| 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 proizvođača | 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% | 4.969,68 | 0,00 | 0,00 | 4.969,68 | | | | | |
| od čega: bez procjene priznate VIPKR ili AKI | 4.969,68 | 0,00 | 0,00 | 4.969,68 | | | | | |
| 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 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: 31.12.2011. |

| | 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 | 0,36 | 0,00 | 0,00 | 0,36 | | | | | | |
| RASPOREĐIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI S OBIROM NA VRSTU IZLOŽENOSTI | | | | | | | | | | |
| Bilančne stavke | 0,36 | | 0,00 | 0,36 | | | | | | |
| 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 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% | 0,36 | 0,00 | 0,00 | 0,36 | | | | | | |
| 100% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | |
| od čega: bez procjene priznate VIPKR ili AKI | 0,36 | 0,00 | 0,00 | 0,36 | | | | | | |
| 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: 31.12.2011. |

| | 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 | 95,31 | 0,00 | 0,00 | 95,31 | | | | | | | 95,31 |
| RASPOREDIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI S OBRZROM NA VRSTU IZLOŽENOSTI | | | | | | | | | | | |
| Bilančne stavke | 95,31 | | 0,00 | 95,31 | | | | | | | 95,31 |
| 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 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% | 95,31 | 0,00 | 0,00 | 95,31 | | | | | | | |
| od čega: dospjela nenaplaćena potraživanja | 95,31 | 0,00 | 0,00 | 95,31 | | | | | | | |
| 200% | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |
| Ostali ponderi rizika | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | | | |

(u tisućama kuna)

| TEHNIKE UMANJENJA KREDITNOG RIZIKA - SLOŽENA METODA FINANCUSKOG KOLATERALA | | | POTPUNO PRILAGODENA VRIJEDNOST IZLOŽENOSTI (E ⁷) | RAŠČLANJIVANJE POTPUNO PRILAGODENIH VRIJEDNOSTI IZLOŽENOSTI IZVANBILAN ČNIH STAVAKA PO KONVERZUSKIM FAKTORIMA | | | | IZNOS IZLOŽENOSTI | KREDITNIM RIZIKOM PONDERIRANI IZNOS IZLOŽENOSTI | KAPITALNI ZAHTEJEV |
|--|---|---|--|---|-----|-----|------|------------------------|---|--------------------|
| ZLOŽENOST PRILAGODENA KOREKTIVNIM FAKTOROM (E ₁₄) | (-) FINANCUSKI KOLATERAL: PRILAGODENA VRIJEDNOST (C ₁₄) | (-) PRILAGODENOST KOREKTIVNIM FAKTORIMA I ROČNOJ NEUSKLAĐENOSTI | | 0% | 20% | 50% | 100% | | | |
| 12 | 13 | 14 | 15=11+12+13 | 16 | 17 | 18 | 19 | 20=15-16-0,8*17-0,5*18 | 21 | 22 |
| | | | 95,31 | | | | | 95,31 | 142,97 | 11,44 |
| | | | 95,31 | | | | | 95,31 | 142,97 | 11,44 |
| | | | 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 | | | | | 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 |
| | | | 95,31 | | | | | 95,31 | 142,97 | 11,44 |
| | | | 95,31 | | | | | 95,31 | 142,97 | 11,44 |
| | | | 0,00 | | | | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | | | 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: 31.12.2011. |

| | 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 PROIŠLAŠLO 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 | |
| | 1 | 2 | 3 | 4=1+3 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 | 11=4+9+10 |
| UKUPNA IZLOŽENOST | 947,66 | 0,00 | 0,00 | 947,66 | | | | | | | 947,66 |
| RASPOREĐIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI S OBIZROM NA VRSTU IZLOŽENOSTI | | | | | | | | | | | |
| Bilančne stavke | 146,49 | | 0,00 | 146,49 | | | | | | | 146,49 |
| Izvanbilančne stavke | 801,17 | | 0,00 | 801,17 | | | | | | | 801,17 |
| 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 |
| 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% | 801,17 | 0,00 | 0,00 | 801,17 | | | | | | | |
| 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 | 801,17 | 0,00 | 0,00 | 801,17 | | | | | | | |
| 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% | 146,49 | 0,00 | 0,00 | 146,49 | | | | | | | |
| od čega: bez procjene priznate VIPKR ili AKI | 146,49 | 0,00 | 0,00 | 146,49 | | | | | | | |
| 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: 31.12.2011. |

| | 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 | 2.014,02 | 0,00 | 0,00 | 2.014,02 | | | | | |
| RASPOREĐIVANJE UKUPNE IZLOŽENOSTI S OBZIROM NA VRSTU IZLOŽENOSTI | | | | | | | | | |
| Bilančne stavke | 2.014,02 | | 0,00 | 2.014,02 | | | | | |
| 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 financijski 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% | 11,08 | 0,00 | 0,00 | 11,08 | | | | | |
| 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 | 11,08 | 0,00 | 0,00 | 11,08 | | | | | |
| 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% | 2.014,02 | 0,00 | 0,00 | 2.014,02 | | | | | |
| od čega: bez procjene priznate VPKR ili AKI | 2.014,02 | 0,00 | 0,00 | 2.014,02 | | | | | |
| 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:31.12.2011. |

| 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 (2008) | POSLOVNA GODINA (2009) | POSLOVNA GODINA (2010) | | | | 4 | 5 | 6=4+7+8 |
| | 1 | 2 | 3 | | | | 4 | 5 | 6=4+7+8 |
| A - JEDNOSTAVNI PRISTUP | 7.725 | 5.788 | 3.135 | 832 | | | | | |
| 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 |
| | | | |
| | | | |

