

PATVIRTINTA
Lietuvos banko valdybos
2015 m. kovo 26 d.
nutarimu Nr. 03-34

UAB "Novus Asset Management"
(įmonės pavadinimas)

302633413, Tilto g. 35/4, Vilnius, 865504044, ---, leonardas.dirzys@novusam.lt
(įmonės kodas, adresas, telefonas, faksas, el. paštas)

Lietuvos banko
Priežiūros tarnybai
Žirmūnų g. 151
LT-09128 Vilnius

Pateikimo terminas Per 42 d. ketvirčiui pasibaigus
Periodiškumas kas ketvirtį
Mato vienetas, tikslumas Eur

Valdymo įmonių kapitalo pakankamumo ataskaitos KPA01

2018-04-30

(data)

Direktorius
(vadovo pareigų pavadinimas)

(parašas)

Leonardas Diržys
(vardas, pavardė)

Direktorius
(atsakingo vykdytojo pareigų pavadinimas)

(parašas)

Leonardas Diržys
(vardas, pavardė)

ĮMONĖS KAPITALO ATASKAITA

	Suma
	1
1. ĮMONĖS KAPITALAS	214452
2. 1.1. 1 LYGIO KAPITALAS	154447
3. 1.1.1. BENDRAS 1 LYGIO NUOSAVAS KAPITALAS (CET1)	154447
4. 1.1.1.1. Kapitalo priemonės, atitinkančios CET1 kapitalo reikalavimus	274309
5. 1.1.1.1.1. Apmokėtos kapitalo priemonės	274309
6. 1.1.1.1.2.* Papildomas straipsnis: reikalavimų neatitinkančios kapitalo priemonės	
7. 1.1.1.1.3. Akcijų priedai	
8. 1.1.1.1.4. (-) Nuosavos CET1 priemonės	0
9. 1.1.1.1.4.1. (-) Tiesiogiai turimos CET1 priemonės	
10. 1.1.1.1.4.2. (-) Netiesiogiai turimos CET1 priemonės	
11. 1.1.1.1.4.3. (-) Dirbūnai turimos CET1 priemonės	
12. 1.1.1.1.5. (-) Faktiniai arba neapibrėžtieji įsipareigojimai pirkti nuosavas CET1 priemones	
13. 1.1.1.2. Nepaskirstytasis pelnas	-115694
14. 1.1.1.2.1. Ankstesnių metų nepaskirstytasis pelnas	-48956
15. 1.1.1.2.2. Reikalavimus atitinkantis pelnas arba nuostoliai	-66738
16. 1.1.1.3. Sukauptos kitos bendrosios pajamos	
17. 1.1.1.4. Kiti rezervai	
18. 1.1.1.5. CET1 koregavimai pritaikius riziką ribojančius filtrus	
19. 1.1.1.6. (-) Prestižas	0
20. 1.1.1.6.1. (-) Prestižas, apskaitomas kaip nematerialusis turtas	
21. 1.1.1.6.2. (-) Prestižas, įtrauktas į reikšmingų investicijų vertinimą	
22. 1.1.1.6.3. Atidėtųjų mokesčių įsipareigojimai, susiję su prestižu	
23. 1.1.1.7. (-) Kitas nematerialusis turtas	-4168
24. 1.1.1.7.1. (-) Kito nematerialiojo turto bendroji suma	-4168
25. 1.1.1.7.2. Atidėtųjų mokesčių įsipareigojimai, susiję su kitu nematerialiuoju turto	
26. skirtumų, atėmus susijusių atidėtųjų mokesčių įsipareigojimus	
27. 1.1.1.9. (-) Abipusė kryžminė CET1 kapitalo dalių nuosavybė	
28. 1.1.1.10. (-) Atskaitymai iš AT1 straipsnių, viršijantys AT1 kapitalą	
29. 1.1.1.11. (-) Kvalifikuotųjų akcijų paketo dalis, turima ne finansų sektoriaus įmonėse	
30. 1.1.1.12. (-) Nebaigti sandoriai	
31. 1.1.1.13. (-) Finansų sektoriaus subjektų, kuriuose įmonė neturi reikšmingų investicijų, CET1 priemonės	
32. dėl laikinųjų skirtumų	
33. 1.1.1.15. (-) Finansų sektoriaus subjektų, kuriuose įmonė turi reikšmingų investicijų, CET1 priemonės	
34. 1.1.1.16. Kiti CET1 kapitalo elementai	
35. 1.1.1.17. (-) Kiti atskaitymai iš CET1 kapitalo	
36. 1.1.2. PAPILDOMAS 1 LYGIO KAPITALAS (AT1)	0
37. 1.1.2.1. Kapitalo priemonės, atitinkančios AT1 kapitalo reikalavimus	0
38. 1.1.2.1.1. Apmokėtos kapitalo priemonės	
39. 1.1.2.1.2.* Papildomas straipsnis: reikalavimų neatitinkančios kapitalo priemonės	
40. 1.1.2.1.3. Akcijų priedai	
41. 1.1.2.1.4. (-) Nuosavos AT1 priemonės	0
42. 1.1.2.1.4.1. (-) Tiesiogiai turimos AT1 priemonės	
43. 1.1.2.1.4.2. (-) Netiesiogiai turimos AT1 priemonės	
44. 1.1.2.1.4.3. (-) Dirbūnai turimos AT1 priemonės	
45. 1.1.2.1.5. (-) Faktiniai arba neapibrėžtieji įsipareigojimai pirkti nuosavas AT1 priemones	
46. 1.1.2.2. (-) Abipusė kryžminė AT1 kapitalo dalių nuosavybė	
47. 1.1.2.3. (-) Finansų sektoriaus subjektų, kuriuose įmonė neturi reikšmingų investicijų, AT1 priemonės	
48. 1.1.2.4. (-) Finansų sektoriaus subjektų, kuriuose įmonė turi reikšmingų investicijų, AT1 priemonės	
49. 1.1.2.5. (-) Atskaitymai iš T2 straipsnių, viršijantys T2 kapitalą	
50. 1.1.2.6. Atskaitymai iš AT1 straipsnių, viršijantys AT1 kapitalą (atskaitoma iš CET1)	
51. 1.1.2.7. Kiti AT1 kapitalo elementai	
52. 1.1.2.8. (-) Kiti atskaitymai iš AT1 kapitalo	
53. 1.2. 2 LYGIO KAPITALAS (T2)	60005
54. 1.2.1. Kapitalo priemonės ir subordinuotosios paskolos, atitinkančios T2 kapitalo reikalavimus	60005
55. 1.2.1.1. Apmokėtos kapitalo priemonės ir subordinuotosios paskolos	60005
56. paskolos	
57. 1.2.1.3. Akcijų priedai	
58. 1.2.1.4. (-) Nuosavos T2 priemonės	0
59. 1.2.1.4.1. (-) Tiesiogiai turimos T2 priemonės	
60. 1.2.1.4.2. (-) Netiesiogiai turimos T2 priemonės	
61. 1.2.1.4.3. (-) Dirbūnai turimos T2 priemonės	
62. 1.2.1.5. (-) Faktiniai arba neapibrėžtieji įsipareigojimai pirkti nuosavas T2 priemones	
63. 1.2.2. (-) Abipusė kryžminė T2 kapitalo dalių nuosavybė	
64. 1.2.3. (-) Finansų sektoriaus subjektų, kuriuose įmonė neturi reikšmingų investicijų, T2 priemonės	
65. 1.2.4. (-) Finansų sektoriaus subjektų, kuriuose įmonė turi reikšmingų investicijų, T2 priemonės	
66. 1.2.5. Atskaitymai iš T2 straipsnių, viršijantys T2 kapitalą (atskaitoma iš AT1)	
67. 1.2.6. Kiti T2 kapitalo elementai	
68. 1.2.7. (-) Kiti atskaitymai iš T2 kapitalo	

ĮMONĖS KAPITALO POREIKIO IR KAPITALO PAKANKAMUMO RODIKLIO ATASKAITA

	Suma
	l
1 1. KAPITALO POREIKIS	20930
2 SUSIJUSIOS RIZIKOS KAPITALO POREIKIS	10774
3 1.1.1. Centrinės valdžios ir centrinių bankų pozicijos	0
4 1.1.2. Regioninės ir vietos valdžios pozicijos	
5 1.1.3. Administracinių vienetų ir pelno nesiekiančių organizacijų pozicijos	
6 1.1.4. Daugiašalių plėtros bankų pozicijos	
7 1.1.5. Tarptautinių organizacijų pozicijos	
8 1.1.6. Institucijų pozicijos	1916
9 1.1.7. Įmonių pozicijos	
10 1.1.8. Mažmeninės pozicijos	
11 1.1.9. Didelės rizikos kategorijoms priklausančių straipsnių pozicijos	
12 1.1.10. Trumpalaikį kredito rizikos vertinimą turinčių institucijų ir įmonių pozicijos	
13 1.1.11. Kolektyvinio investavimo subjektų pozicijos	8858
14 1.1.12. Kitos pozicijos	
15 1.2. ATSISKAITYMŲ RIZIKOS KAPITALO POREIKIS	0
16 1.3. UŽSIENIO VALIOTOS KURSO RIZIKOS KAPITALO POREIKIS	
17 1.4. BIRŽOS PREKIŲ KAINOS RIZIKOS KAPITALO POREIKIS	
18 1.5. OPERACINĖS RIZIKOS KAPITALO POREIKIS	10156
19 2. PAPILDOMA INFORMACIJA	
20 2.1. MINIMALUS PRADINIS KAPITALAS	125000
21 2.2. VIENAS KETVIRTADALIS PRAĖJUSIŲ METŲ PRIDĖTINIŲ IŠLAIDŲ SUMOS	22629
22 2.3. DIDŽIAUSIA KAPITALO POREIKIŲ SUMA IŠ ŠIŲ DYDŽIŲ:	125000
23 2.3.1. Minimalus pradinis kapitalas	125000
24 2.3.2. Vienas ketvirtadalis praėjusių metų pridėtinių išlaidų sumos	22629
25 2.3.3. Kapitalo poreikis	20930
26 3. KAPITALO PAKANKAMUMO RODIKLIS (KPA1 1./KPA2 2.3)	1,7156

ATSISKAITYMŲ RIZIKOS ATASKAITA

	SUTARTYJE NURODYTA ATSISKAITYMO SUMA	ATSISKAITYMO SUMOS IR DABARTINĖS RIZIKOS VERTĖS SKIRTUMAS	KAPITALO POREIŠIO DEFICITAS, PROC.	KAPITALO POREIŠIS
	1	2	3	4
1 Bendra sandorių, pagal kuriuos neatsiskaityta, suma				
2 Sandoriai, pagal kuriuos neatsiskaityta iki 4 dienų			0	
3 Sandoriai, pagal kuriuos neatsiskaityta 5-15 dienų			8	
4 Sandoriai, pagal kuriuos neatsiskaityta 16-30 dienų			50	
5 Sandoriai, pagal kuriuos neatsiskaityta 31-45 dienas			75	
6 Sandoriai, pagal kuriuos neatsiskaityta 46 dienas arba ilgiau			100	

UŽSIENIO VALIUTOS KURSO RIZIKOS ATASKAITA

	VISOS POZICIJOS		GRYNSIOS POZICIJOS		POZICIJOS, KURIOMS TAIKOMAS KAPITALO POREKIO KOEFICIENTAS		KAPITALO POREKIS
	ILGOSIOS	TRUMPOSIOS	ILGOSIOS	TRUMPOSIOS	ILGOSIOS	TRUMPOSIOS	
	1	2	3	4	5	6	
1 POZICIJŲ SUMA	0	0					
2 Visos kitos valiutos (įskaitant KIS, vertinamus kitomis valiutomis)							
3 Auksas							
4 ATASKAITOS PAGAL POZICIJŲ RŪŠĮ							
5 Kitas turtas ir įsipareigojimai, išskyrus nebalansinius straipsnius ir išvesdines finansines priemones	158615						
6 Nebalansiniai straipsniai							
7 Išvesdinės finansinės priemonės							
8 Papildomi straipsniai. VALIUTOS POZICIJOS							
9 Euro	158615						
10 Šveicarijos frankas							
11 Jena							
12 Zlotas							
13 Rusijos rublis							
14 Švedijos krona							
15 Šveicarijos frankas							
16 JAV doleris							
17 Norvegijos krona							
18 Kitos							

BIRŽOS PREKIŲ KAINOS RIZIKOS ATASKAITA

	VISOS POZICIJOS		GRYNSIOS POZICIJOS		POZICIJOS VERTĖ	KAPITALO POREIŲ KOEFICIENTAS, PROC.	KAPITALO POREIŠIS
	ILGOSIOS	TRUMPOSIOS	ILGOSIOS	TRUMPOSIOS			
	1	2	3	4	5	6	7
1 VISOS BIRŽOS PREKIŲ POZICIJOS							
2 Terminų atlikimo metodas							
3 Terminų grupė ≤ 1 metai							
4 0 ≤ 1 mėnuo							
5 > 1 ≤ 3 mėnesiai							
6 > 3 ≤ 6 mėnesiai							
7 > 6 ≤ 12 mėnesių							
8 Terminų grupė > 1 metai ir ≤ 3 metai							
9 > 1 ≤ 2 metai							
10 > 2 ≤ 3 metai							
11 Terminų grupė > 3 metai							
12 Kiekvienoje terminų grupėje suderintos ilgiosios ir trumposios pozicijos							
13 Tarp dviejų terminų grupių suderintos pozicijos							
14 Likusios nesuderintos pozicijos							
15 Supaprastintas metodas							
16 Gryniosios pozicijos							
17 Bendrosios pozicijos							
18 Kapitalo poreikis prilyginamas garantinei įmokai							
19 Kitų biržos prekių sandoriai arba sandoriai, kurių kapitalo poreikis prilyginamas garantinei įmokai							

OPERACINĖS RIZIKOS ATASKAITA

		GRYNSIOS PAJAMOS			KAPITALO POREIKIS
		PRIEŠ 3 METUS	PRIEŠ 2 METUS	PERNAI	
		1	2	3	4
1	VERSLO LINIJOS PAGAL BAZINIO INDIKATORIAUS METODĄ	32693	79932	90495	10156