

UAB "MP PENSION FUNDS BALTIC"

300668928, Savanorių pr. 349, Kaunas (Registracija Rūdninkų g. 18/2, Vilnius), 8-37-719302

Vadovas - Ramūnas Stankevičius

Vykdytojas - Dovilė Bajalienė

KAPITALO PAKANKAMUMO SKAIČIAVIMO ATASKAITA

Ataskaitinio laikotarpio pabaiga - 2010.12.31

1 lentelė. KAPITALO SUVESTINĖ

Eil.Nr.	EILUTĖS PAVADINIMAS	SUMA, LT
I.	ĮMONĖS KAPITALAS	3 313 950
C.	PIRMO LYGIO (PIRMINIS) KAPITALAS	3 348 159
A.	Pradinis kapitalas	10 630 531
A1.	Apmokėtas įstatinis kapitalas	11 181 200
A2.	Akcijų priedai	
A3.	Rezervai (išskyrus perkainojimo rezervą)	
A4.	Praėjusių metų nepaskirstytasis pelnas, likęs po galutinio pelno paskirstymo, arba praėjusių metų nuostoliai	(550 669)
A5.	Einamųjų metų tarpinis arba paskutiniųjų praėjusių metų nepaskirstytasis pelnas	
a.	Kitos kapitalo priemonės (KKP)	-
a1.	KKP1, kurių emisijos dokumentuose numatyta konvertuoti jas į įmonės įstatinį kapitalą (ne daugiau nei 50 proc. pirminio kapitalo)	
a2.	KKP2, kurių emisijos dokumentuose įmonei numatyta paskata jas išpirkti (ne daugiau kaip 15 proc. pirminio kapitalo)	
a3.	KKP3, visos kitos kapitalo priemonės, neįskaičiuotos į a1 ir a2 eilutes (ne daugiau kaip 35 proc. pirminio kapitalo)	
B.	(-) Atskaitymai	(7 282 372)
B1.	(-) Supirktos nuosavos akcijos	
B2.	(-) Einamųjų metų nuostoliai	(2 444 616)
B3.	(-) Nematerialusis turtas	(2 708)
B4.	(-) Išankstiniai apmokėjimai ir būsimųjų laikotarpių sąnaudos, išskyrus išankstinius apmokėjimus už gautiną finansinį turą	(4 835 048)
B5.	(-) Kiti atskaitymai	
D.	ANTRO LYGIO KAPITALAS	-
D1.	Ilgalaikio materialiojo ir finansinio turto perkainojimo rezervai	

D2.	Privilegijuotųjų akcijų su kaupiamuoju dividendu nominali vertė	
D3.	Subordinuotos paskolos	
D4.	Kitos kapitalo priemonės (KKP4)	
E.	TREČIO LYGIO KAPITALAS	-
E1.	Grynasis einamojo laikotarpio prekybos knygos pelnas	
E2.	Trumpalaikės subordinuotos paskolos	
F.	(-) NELIKVIDUSIS TURTAS	(34 209)
F1.	(-) Ilgalaikis materialusis turtas, išskyrus kaip užstatas perduotų žemės ar pastatų dalį, kurios vertė atitinka gautos paskolos vertę	(34 209)
F2.	(-) Atsargos	
F3.	(-) Investicijos į įmonių, išskyrus kredito ir finansų įstaigų, nuosavybės vertybinius popierius ir kitos investicijos į šias įmones, jei tos investicijos negali būti iš karto	
F4.	(-) Investicijos į kitų finansų ir kredito įstaigų nuosavybės vertybinius popierius ir toms įstaigoms suteiktos subordinuotos paskolos, išskyrus pozicijas, kurios įtrauktos į prekybos knygą	
F5.	(-) Paskolos ir kitos gautinos sumos, kurias numatoma gauti vėliau kaip po 90 dienų (įskaitant trumpesnio laikotarpio paskolas, kurios negražinamos suėjus terminui ar jų gražinimo laikotarpis pratęsiamas), taip pat atidėtojo mokesčio turtas ir įmokos į biržos garantinį fondą	
F6.	(-) Indėliai, kurių atsiėmimo laikotarpis yra ilgesnis kaip 90 dienų (įskaitant trumpesnio laikotarpio indėlius, kurie pagal sutartis gali būti automatiškai pratęsimi), išskyrus mokėjimus, susijusius su ateities arba pasirinkimo sandoriais, kuriems nustatytas privalomas įnašas	
F7.	(-) Dukterinių įmonių nuostoliai	
2.	KAPITALO POREIKIS	222 055
2.1.	KREDITO IR GAUTINŲ SUMŲ SUMAŽĖJIMO RIZIKOS KAPITALO POREIKIS	119 864
2.2.	POZICIJŲ, ATSISKAITYMŲ IR SANDORIO ŠALIES, DIDELIŲ POZICIJŲ, UŽSIENIO VALIUTOS KURSO, BIRŽOS PREKIŲ KAINOS, OPERACINĖS RIZIKOS KAPITALO POREIKIS	102 191
2.2.1.	Pozicijų rizikos kapitalo poreikis	
2.2.1.1.	Skolos finansinių priemonių rizikos kapitalo poreikis	
2.2.1.2.	Nuosavybės vertybinių popierių rizikos kapitalo poreikis	
2.2.2.	Atsiskaitymų ir sandorio šalies kredito rizikos kapitalo poreikis	-

2.2.2.1.	Atsiskaitymų rizikos kapitalo poreikis	
2.2.2.2.	Sandorio šalies kredito rizikos kapitalo poreikis	
2.2.3.	Didelių pozicijų rizikos kapitalo poreikis	-
2.2.4.	Užsienio valiutos kurso rizikos kapitalo poreikis	77 785
2.2.5.	Biržos prekių kainos rizikos kapitalo poreikis	
2.2.6.	Operacinės rizikos kapitalo poreikis	24 406
2.2.6.1.	Operacinė rizika naudojant bazinio indikatoriaus metodą	24 406
2.2.6.2.	Operacinė rizika naudojant standartizuotą metodą	
3.	PAPILDOMA INFORMACIJA	
3.1.	Minimalus pradinis kapitalas	1 035 840
3.2.	Vienas ketvirtadalis įmonės praėjusių metų pridėtinių išlaidų sumos	
3.3.	Kapitalo perviršis (+) arba deficitas (-)	2 278 110
3.4.	Kapitalo perviršis (+) arba deficitas (-)	3 313 950
3.5.	Kapitalo perviršis (+) arba deficitas (-)	3 091 895
3.6.	Kapitalo perviršis (+) arba deficitas (-)	9 594 691
3.7.	Didžiausia kapitalo poreikių suma iš šių dydžių:	
	1. minimalaus pradinio kapitalo sumos;	
	2. vienas ketvirtadalis įmonės praėjusių metų pridėtinių išlaidų sumos;	1 035 840
	3. kapitalo poreikio sumos	
3.8.	KAPITALO PAKANKAMUMO RODIKLIS	3.20

Sutartiniai ženklai:

*Tik A kategorijos finansų maklerio įmonėms.

Įmonės vadovo parašas

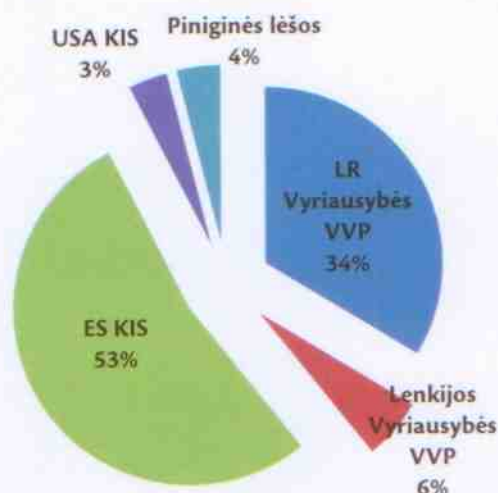
Vykdytojo parašas

Papildoma informacija apie valdymo įmonės kapitalo pakankamumo rodiklio skaičiavimą

KREDITO IR GAUTINŲ SUMŲ SUMAŽĖJIMO RIZIKOS KAPITALO POREIKIS

Įmonė kredito rizikos ir gautinų sumų sumažėjimo (išskyrus prekybos knygoje įtrauktą turtą bei nelikvidųjį turtą) rizikos kapitalo poreikį apskaičiuoja vadovaudamasi standartizuotu metodu. Kredito ir gautinų sumų sumažėjimo rizikos kapitalo poreikis nustatomas įmonės apskaičiuotą ir pagal riziką įvertintą įmonės turto ir nebalansinių straipsnių (išskyrus į prekybos knygą įtrauktą turtą bei nelikvidųjį turtą) pozicijų vertę padauginus iš 8 proc. Pagal riziką įvertinta pozicijų vertė yra apskaičiuojama atsižvelgiant į rizikos koeficientus, kurie yra nustatomi remiantis Finansų maklerio įmonių ir valdymo įmonių kapitalo pakankamumo reikalavimų taisyklėse.

Pagrindinės pozicijoms, kurioms yra skaičiuojamos šios rizikos yra įmonės investicinis portfelis (reikalaujama minimali investicinio portfelio 250 tūkst. EUR suma), taip pat įmonės apyvartinės lėšos finansų įstaigose. Siekiant sumažinti šią riziką įmonė apyvartinės lėšas sutelkia aukštesnio reitingo įvertinimo finansų įstaigose.



KREDITO RIZIKOS VERTINIMAI (REITINGAI)

Kiekvienai įmonės kredito ar gautinos sumos pozicijai (investicinio portfelio ir finansų įstaigoms) yra nustatomas reitingas, remiantis Lietuvos banko pripažintais IKVI ilgalaikių ir trumpalaikių kredito rizikos vertinimais (reitingais):

KKŽ	Standard & Poor's reitingai		Moody's Investors Service reitingai		Fitch Ratings reitingai	
	Ilgalaikiai	Trumpalaikiai	Ilgalaikiai	Trumpalaikiai	Ilgalaikiai	Trumpalaikiai
1	Nuo AAA iki AA-	A-1+, A-1	Nuo Aaa iki Aa3	P-1	Nuo AAA iki AA-	F1+, F1
2	Nuo A+ iki A-	A-2	Nuo A1 iki A3	P-2	Nuo A+ iki A-	F2
3	Nuo BBB+ iki BBB-	A-3	Nuo Baa1 iki Baa3	P-3	Nuo BBB+ iki BBB-	F3
4	Nuo BB+ iki BB-	B-1, B-2, B-3, C	Nuo Ba1 iki Ba3	NP	Nuo BB+ iki BB-	Mažiau nei F3
5	Nuo B+ iki B-		Nuo B1 iki B3		Nuo B+ iki B-	
6	Mažiau nei B-		Mažiau nei B3		Mažiau nei B-	