

2016-03-25

Vidaus kapitalo pakankamumo vertinimo procesas ir jo rezultatai

Steponkus&Co FMAB (toliau Įmonė) reguliariai skaičiuoja kapitalo pakankamumo rodiklį.

Pagal galiojančią tvarką, kas ketvirtį Įmonė ruošia kapitalo pakankamumo ataskaitą, kuri pateikiama Lietuvos Bankui.

Sukauptas Įmonės kapitalas skirtas Įmonės veiklos stabilumui garantuoti, todėl Įmonė investuodama prisiima ne didesnę nei vidutinį rizikos lygį. Veikdama Įmonė remiasi konservatyvumo principais ir stengiasi kiekvienu atveju mažinti su investiciniais veiksmais susijusią riziką. Savo kapitalą ir rezervus (neprekybos knygos vertybinių popierių bei obligacijų pozicijos) Įmonė yra investavusi į AB "Jūratė" ir AB "Centro investicija" akcijas, kurios apskaitytos įsigijimo arba nepriklausomo turto vertintojo nustatyta verte. Reaguodama į Lietuvos Banko patikrinimo išvadas Įmonė realizavo dalį turimų akcijų (5400 vnt. AB "Jūratė" PVA po 11,70 EUR ir 10000 vnt. AB "Centro investicija" PVA po 1,70 EUR). Iki 2016.04.30 dienos Įmonė realizuos likusias turimas akcijas taip pilnai įgyvendindama Lietuvos Banko reikalavimus.

Rizikos rūšių svarba Įmonei yra nustatyta įmonės rizikos valdymo politikoje. Pagrindinėmis rizikomis yra identifikuotos gautinų pajamų ir turimo finansinio turto vertės sumažėjimo rizikos.

Įmonė kontroliuoja gautinų sumų srautus, siekia apsaugoti Įmonės valdomą turtą nuo vertės sumažėjimo. Atsižvelgiant į Įmonės veiklos pobūdį, bei, laikui bėgant, kintant veiklos pobūdžiui ir su tuo susijusioms rizikoms, Įmonė gali ir yra įsipareigojusi kontroliuoti, peržiūrėti ir, reikalui esant, keisti/papildyti rizikų sąrašą. Už identifikuotų rizikų kiekybinį ir kokybinį paskaičiavimą, jų kontrolę yra atsakingi Įmonės vadovai, o portfelių lygyje – finansų makleris Giedrius Steponkus.

2015 m. gruodžio 31 d. Steponkus&Co FMAB kapitalo pakankamumo rodiklis (pagal audituotus J.Bareišos individualios audito įmonės duomenis) buvo:

- pradinis nuosavas kapitalas 125889 EUR,
- nuosavos lėšos – pirmo lygio kapitalas 118018 EUR,
- bendras pirmo lygio kapitalo koeficientas sudaro 0,5086 (reikalavimas 0,045),
- pirmo lygio kapitalo pakankamumo koeficientas lygus 0,5086 (reikalavimas ne mažiau kaip 0,06),
- viso kapitalo pakankamumo koeficientas lygus 0,5086 (reikalavimas ne mažiau 0,08).

Direktorius



Giedrius Steponkus