

UAB “ORION ASSET MANAGEMENT” 2020 M. NUOSAVO KAPITALO PAKANKAMUMO ATASKAITA

- A. Nuosavų lėšų reikalavimų vykdymo rezultatai 2020 12 31 d.
- B. Kapitalo poreikio, esant kredito ir gautinų sumų sumažėjimo, rinkos ir operacinei rizikai, nustatymo metodai.
- C. Svarbiausia informacija apie į įmonės kapitalą įtrauktų subordinuotųjų paskolų ir kitų skolos priemonių terminus ir sąlygas 2020 12 31 d.
- D. Kita svarbi informacija apie kredito ir gautinų sumų sumažėjimo riziką, rinkos riziką ir operacinę riziką.

Šiuo dokumentu pateikiama papildoma informacija, kuri paruošta vadovaujantis Europos Parlamento ir Tarybos reglamentu (ES) Nr.575/2013 bei Lietuvos Banko patvirtintomis Valdymo įmonių nuosavų lėšų dydžio apskaičiavimo taisyklėmis.

A. Įmonė visuomet turi tenkinti šiuos nuosavų lėšų reikalavimus:

1. Valdymo įmonė privalo turėti ne mažesnę kaip 125 000 eurų pradinį kapitalą.
2. Nuosavas lėšas sudarantis 2 lygio kapitalas negali būti didesnis kaip trečdalis 1 lygio kapitalo.
3. Nuosavos lėšos turi nuolat būti ne mažesnės už didesnę iš šių dydžių:
 - 3.1. minimalų pradinį įmonės kapitalą;
 - 3.2. nuosavų lėšų poreikį, apskaičiuotą pagal Taisyklių III skyriaus nuostatas;
 - 3.3. vieną ketvirtadalį įmonės praėjusių metų pridėtinių išlaidų sumos.

Įmonės nuosavų lėšų rodikliai 2020 12 31 d.:

1.	ĮMONĖS NUOSAVOS LĖŠOS	320 463
2.	BENDRAS 1 LYGIO NUOSAVAS KAPITALAS (CET1)	320 463
3.	Įmonės pradinis kapitalas	399 676
4.	2 LYGIO KAPITALAS (T2)	---
5.	DIDŽIAUSIA KAPITALO POREIKIŲ SUMA IŠ ŠIŲ DYDŽIŲ:	257 152
5.1.	Minimalus pradinis įmonės kapitalas	125 000
5.2.	Vienas ketvirtadalį praėjusių metų pridėtinių išlaidų sumos	251 395
5.3.	Nuosavų lėšų poreikis, apskaičiuotas pagal Taisyklių III skyriaus nuostatas	257 152
6.	KAPITALO PAKANKAMUMO RODIKLIS (1 eilutė/5 eilutė)	1,2462

B. Kapitalo poreikio, esant kredito ir gautinų sumų sumažėjimo, rinkos ir operacinei rizikai, nustatymo metodai:

1. pripažintų išorinių kredito rizikos vertinimo institucijų ir eksporto kredito agentūrų, kurių kredito rizikos vertinimus (reitingus) įmonė pasirinko naudoti nustatydamą rizikos koeficientus, pavadinimus.
 Bendrovė naudoja šiuos Lietuvos banko pripažintų išorinių kredito rizikos vertinimo institucijų ilgalaikius ir trumpalaikius kredito rizikos reitingus:

Kredito kokybės žingsnis	Standard & Poor's		Moody's Investors Service		Fitch Ratings	
	Ilgalaikiai reitingai	Trumpalaikiai reitingai	Ilgalaikiai reitingai	Trumpalaikiai reitingai	Ilgalaikiai reitingai	Trumpalaikiai reitingai
1	Nuo AAA iki	A-1+, A-1	Nuo Aaa iki	P-1	Nuo AAA iki	F1+, F1

	AA-		Aa3		AA-	
2	Nuo A+ iki A-	A-2	Anuo 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-	

2. pozicijų grupes, kurioms taikomi išorinės kredito rizikos vertinimo institucijos ir eksporto kredito agentūros vertinimai:
- Centrinės valdžios ir centrinių bankų pozicijoms;
 - Institucijų pozicijoms;
 - Įmonių pozicijoms;
 - Kolektyvinio investavimo subjektų pozicijoms;
 - Kitos pozicijoms;

3. pozicijų grupių pasiskirstymą pagal reikšmingas geografines teritorijas, ekonominės veiklos arba sandorio šalies rūšį, terminą, likusį iki sandorio galiojimo pabaigos:

2020 12 31 d. Bendrovės kapitalas buvo investuotas į:

- Lietuvoje registruotus investicinius fondus;
- Vertybinius popierius, kuriais prekiaujama NASDAQ OMX biržoje;
- Vertybinius popierius, kuriais prekiaujama JAV biržose;
- Pinigus atsiskaitomosiose sąskaitose Lietuvos kredito įstaigose.

2020 12 31 d. Bendrovės investicijos JAV akcijų rinkose sudarė mažiau nei 1 proc. Bendrovės kapitalo.

4. informacija apie pozicijas, kurios yra nuvertėjusios:

2020 12 31 d. Bendrovės turimos pozicijos nebuvo nuvertėjusios.

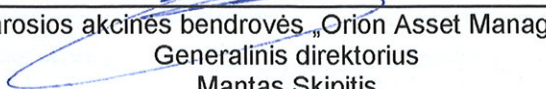
5. Nuvertėjusių pozicijų, vertės koregavimų ir atidėjinių reikšmingų sumų pasiskirstymą pagal ekonominės veiklos, sandorio šalies ir geografines teritorijas:

2020 12 31 d. Bendrovė neturėjo nuvertėjusių pozicijų, vertės koregavimų ir atidėjinių.

C. Svarbiausia informacija apie įmonės kapitalą įtrauktų subordinuotųjų paskolų ir kitų skolos priemonių terminus ir sąlygas.

2020 12 31 Bendrovė neturėjo į Bendrovės kapitalą įtrauktų subordinuotųjų paskolų.

D. Kita svarbi informacija apie kredito ir gautinų sumų sumažėjimo riziką, rinkos riziką ir operacinę riziką


 Uždarosios akcinės bendrovės „Orion Asset Management“
 Generalinis direktorius
 Mantas Skipitis