

Locusta Absolute – 30.09.2015.

Izloženost rizicima

Društvo upravlja rizicima u skladu sa zakonskim propisima, te slijedeći smjernice domaćih i inozemnih institucija i regulatornih tijela (prvenstveno HANFA-e). Društvo će u svome poslovanju upravljati rizicima na način da će ih permanentno identificirati, procjenjivati, mjeriti, te pokušavati izbjegavati ili smanjivati, a ako to nije moguće, kontrolirano preuzimati.

Na poslovanje Fonda djeluje veliki broj rizika od kojih su najznačajniji tržišni rizici, kreditni rizici, rizik likvidnosti i operativni rizik.

Kod tržišnih rizika posebno se mjere Macaulay duration, modificirana duracija, valutni rizik, VaR (apsolutni, parametarski i Monte Carlo), te back testing VaR-ova, stress test, rizik likvidnosti kao i stress test na likvidnost, te rizik volatilnosti Fonda.

Kod kreditnih rizika Društvo posebno mjeri rizik druge ugovorne strane i rizik namire.

Trenutni profil rizičnosti Fonda je visok.

U svrhu zaštite ulagatelja Društvo je uspostavilo procedure za upravljanje rizicima kojima se definira kontrola, analiza i nadzor nad rizicima u portfelju Fonda.

Ukupan iznos nagrađivanja u poslovnoj godini

U poslovnoj godini nije bilo nagrađivanja niti jednog zaposlenika Društva.

Postotak imovine Fonda koji podliježe posebnim mjerama koje proizlaze iz njezine nelikvidnosti

Trenutni postotak imovine Fonda koji podliježe posebnim mjerama koje proizlaze iz njezine nelikvidnosti. je 0%.

Ukupan iznos financijske poluge

Pravilima Fonda propisano je da Fond neće koristiti financijsku polugu. Na dan 30.09.2015. godine financijska poluga računata u skladu s bruto metodom iznosila je 0,98, dok je računata metodom preuzetih obveza iznosila 1,006.