

**Locusta Absolute – 30.09.2018.**

### **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 30.09.2018. godine financijska poluga računata u skladu s bruto metodom iznosila je 0,98 dok je računata metodom preuzetih obveza iznosila 1,01.