

## INFORMACJE PODLEGAJĄCE UJAWNIENIU PRZEZ EFIX DOM MAKLERSKI S.A. WEDŁUG STANU NA DZIEŃ 31 GRUDNIA 2017 ROKU

### I. PODSTAWA PRAWNA

EFIX Dom Maklerski S.A. (Dom Maklerski) ujawniania informacje, w tym w zakresie adekwatności kapitałowej zgodnie z obowiązującym prawem, w oparciu o uregulowania zawarte w Rozporządzeniu Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 575/2013 z dnia 26 czerwca 2013 r. w sprawie wymogów ostrożnościowych dla instytucji kredytowych i firm inwestycyjnych, zmieniające rozporządzenie (UE) nr 648/2012 (Rozporządzenie CRR), Dyrektywy Parlamentu Europejskiego i Rady 213/36/UE z dnia 26 czerwca 2013 r. w sprawie warunków dopuszczenia instytucji kredytowych do działalności oraz nadzoru ostrożnościowego nad instytucjami kredytowymi i firmami inwestycyjnymi (Dyrektywa CRD), Rozporządzenia Wykonawczego Komisji (UE) nr 1423/2013 z dnia 20 grudnia 2013 r. ustanawiające wykonawcze standardy techniczne w zakresie wymogów dotyczących ujawniania informacji na temat funduszy własnych zgodnie z Rozporządzeniem Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 575/2013 (Rozporządzenie COREP).

### II. PODSTAWOWE INFORMACJE DOTYCZĄCE EFIX DOM MAKLERSKI S.A.

- EFIX Dom Maklerski S.A. z siedzibą w Poznaniu,
- Numer KRS 0000348420 Sąd Rejonowy Poznań – Nowe Miasto i Wilda w Poznaniu, VIII Wydział Gospodarczy,
- Numer statystyczny REGON 301346369,
- Numer identyfikacji podatkowej NIP 2090001747,
- Decyzja numer DFL/4020/80/48/I/96/I/10/11/KW Komisji Nadzoru Finansowego z dnia 8 lutego 2011 roku na prowadzenie działalności maklerskiej w zakresie:
  - 1) przyjmowania i przekazywania zleceń nabycia lub zbycia instrumentów finansowych.
  - 2) zarządzania portfelami, w skład których wchodzi jeden lub większa liczba instrumentów finansowych.
  - 3) doradztwa inwestycyjnego,
  - 4) doradztwa dla przedsiębiorstw w zakresie struktury kapitałowej, strategii przedsiębiorstwa lub innych zagadnień związanych z taką strukturą lub strategią,
  - 5) doradztwa i innych usług w zakresie łączenia, podziału oraz przejmowania przedsiębiorstw.
  - 6) sporządzania analiz inwestycyjnych, analiz finansowych oraz innych rekomendacji o charakterze ogólnym dotyczących transakcji w zakresie instrumentów finansowych,
  - 7) wykonywania czynności określonych w art. 69 ust. 2 oraz 69 ust. 4 pkt 1 -7 ustawy z dnia 29 lipca 2005 r. o obrocie instrumentami finansowymi, których przedmiotem są instrumenty bazowe instrumentów pochodnych, wskazanych w art. 2 ust. 1 pkt 2 lit. d-f oraz i wymienionej wyżej ustawy, jeżeli czynności te pozostają w związku z działalnością maklerską,
- EFIX Dom Maklerski S.A. ujawnia informacje związane z funduszami własnymi i wymogami kapitałowymi na podstawie danych w ujęciu jednostkowym,
- informacje ujawniane są w języku polskim, w walucie polskiej PLN.

### III. MIEJSCE I CZĘSTOTLIWOŚĆ UJAWNIANIA INFORMACJI

1. Dom Maklerski ujawnia informacje przez podanie ich do publicznej wiadomości na stronie internetowej: [www.efixdm.pl](http://www.efixdm.pl).
2. Dom Maklerski ujawnia informacje, o których mowa w niniejszym dokumencie co najmniej raz w roku.
3. Termin corocznej publikacji ujawnianych informacji pokrywa się z terminem publikacji sprawozdania finansowego.
4. Niniejszy dokument zatwierdzany jest przez Zarząd Domu Maklerskiego w drodze uchwały.

### IV. CELE I STRATEGIE ZARZĄDZANIA RYZYKIEM

1. Cele i strategie w zakresie zarządzania ryzykiem:

#### a) Strategie i procesy zarządzania różnymi rodzajami ryzyka

W Domu Maklerskim obowiązuje „System zarządzania ryzykiem”, który określa wewnętrzne strategie i procedury identyfikacji, pomiaru, monitorowania i kontroli ryzyka. Strategie i procedury, podlegają regularnej weryfikacji w celu ich dostosowania do zmian profilu ryzyka działalności prowadzonej przez Dom Maklerski i otoczenia gospodarczego, w którym działa Dom Maklerski.

Monitorowanie ryzyka stanowi część bieżącego procesu zarządzania ryzykiem i sprawozdawczości o ryzyku w działalności Domu Maklerskiego.

Dom Maklerski opracowuje i stosuje zasady pomiaru i zarządzania ryzykami, które uznaje za istotne.

#### b) Struktura i organizacja funkcji zarządzania ryzykiem

„System zarządzania ryzykiem” zatwierdzany jest przez Radę Nadzorczą Domu Maklerskiego, który również dokonuje weryfikacji strategii i procedur.

Dom Maklerski bada i ocenia, w ramach audytu wewnętrznego, adekwatność i skuteczność wdrożonego „Systemu zarządzania ryzykiem”, jak również poziom jego wykorzystywania.

Nadzór nad zgodnością polityki Domu Maklerskiego w zakresie podejmowania ryzyka ze strategią działania i planem finansowym Domu Maklerskiego sprawuje Rada Nadzorcza.

#### c) Zakres i charakter systemów raportowania i pomiaru ryzyka

Dom Maklerski w ramach „Systemu zarządzania ryzykiem” identyfikuje następujące rodzaje ryzyka: kredytowe, rynkowe, płynności, operacyjne, modeli, kapitałowe, biznesowe, rezydualne, z tytułu transakcji sekurytyzacyjnych, stopy procentowej w portfelu niehandlowym nadmiernej dźwigni, braku zgodności z prawem, utraty reputacji makroekonomiczne i systemowe.

Identyfikacja bieżących i przyszłych ryzyk istotnych obejmuje określenie wszelkich ryzyk, na które Dom Maklerski jest narażony w swojej działalności oraz ich ocenę pod względem istotności. Identyfikację ryzyk przeprowadza Zarząd okresowo co najmniej raz na rok, a także w sytuacji zdefiniowania lub wystąpienia innych ryzyk mających wpływ na działalność Domu Maklerskiego. W ramach informacji zarządczej raporty odnośnie wartości poszczególnych ryzyk przekazywane są Zarządowi i Radzie Nadzorczej.

#### d) Strategie zabezpieczania i ograniczania ryzyka oraz monitorowania stałej skuteczności instrumentów zabezpieczających i czynników łagodzących

Dom Maklerski stosuje metody identyfikacji, pomiaru i monitorowania ryzyk, w szczególności ryzyk istotnych a w ramach wybranych obszarów wprowadził limity wewnętrzne, służące ograniczaniu tych ryzyk.

Dom Maklerski identyfikował prowadzoną działalność określoną, jako nieznaczącą.

- e) **Oświadczenie Zarządu Domu Maklerskiego na temat adekwatności ustaleń dotyczących zarządzania ryzykiem, dającego pewność, że stosowane systemy zarządzania ryzykiem są odpowiednie z punktu widzenia profilu i strategii Domu Maklerskiego**

Zarząd oświadcza, że stosowane systemy zarządzania ryzykiem są odpowiednie z punktu widzenia profilu i strategii Domu Maklerskiego.

- f) **Oświadczenie Zarządu Domu Maklerskiego na temat ryzyka, w którym pokrótce omówiono ogólny profil ryzyka związany ze strategią działalności. Przedmiotowe oświadczenie zawiera kluczowe wskaźniki i dane liczbowe, zapewniające zewnętrznym zainteresowanym stronom całościowy obraz zarządzania ryzykiem przez instytucję, w tym interakcji między profilem ryzyka, a tolerancją na ryzyko określoną przez Zarząd.**

Zarząd Domu Maklerskiego oświadcza, że niniejsze dokument zawiera pełną informację na temat ogólnego profilu ryzyka związanego z działalnością Domu Maklerskiego w tym kluczowe wskaźniki i dane liczbowe, zapewniające zewnętrznym zainteresowanym stronom całościowy obraz zarządzania ryzykiem i interakcji między profilem ryzyka instytucji a tolerancją na ryzyko.

## 2. Zasady zarządzania:

- a) **Liczba stanowisk dyrektorskich zajmowanych przez członków Zarządu**

Zarząd Domu Maklerskiego składa się z dwóch członków.

- b) **Polityka rekrutacji dotycząca wyboru członków Zarządu**

Kwalifikacje odpowiadają wymaganiom stanowisk i pełnionych funkcji przez członków Zarządu, przy czym pod pojęciem kwalifikacji rozumie się posiadane wykształcenie, doświadczenie zawodowe oraz odbyte szkolenia zawodowe.

Powołanie i odwołanie członków Zarządu wymaga każdorazowo zgłoszenia do Komisji Nadzoru Finansowego.

- c) **Strategia w zakresie zróżnicowania w odniesieniu do wyboru członków Zarządu, jego celów i wszelkich odpowiednich zadań określonych w tej polityce oraz zakresu, w jakim te cele i zadania zostały zrealizowane.**

Członków Zarządu wybiera i odwołuje Rada Nadzorcza.

Zarząd składa się z dwóch członków, powołanych na nową wspólną kadencję od dnia 8 grudnia 2014 roku.

Zakres zadań dla poszczególnych członków Zarządu uwzględnia ich kompetencje a ich działanie umożliwia sprawowanie zarządzania w działalności podmiotu rynku finansowego.

- d) **Komitet do spraw ryzyka**

Z uwagi na nieznaczącą skalę prowadzonej działalności w Domu Maklerskim nie utworzono komitetu do spraw ryzyka. Za zarządzanie ryzykiem odpowiada Zarząd.

- e) **Opis przepływu informacji na temat ryzyka kierowanych do Zarządu**

Na bieżąco, w szczególności, w sytuacji zaistnienia zdarzeń mogących wpłynąć negatywnie na spełnianie wymogów kapitałowych, Zarząd informowany jest w zakresie: poziomu funduszy własnych, poziomu ekspozycji na ryzyko i współczynników kapitałowych, przekroczeń limitów a w ramach raportów kwartalnych dodatkowo informacje dotyczące wykorzystania limitu ryzyka płynności, i ryzyka walutowego, wielkość ryzyka kredytowego z podziałem na klasy, wielkość ryzyka operacyjnego, wykorzystania poziomu apetytu na ryzyko.

Dział Audytu Wewnętrznego przynajmniej raz w roku dokonuje czynności związanych z oceną wdrożonego systemu zarządzania ryzykiem, w tym w szczególności: poziomem jego wykorzystania, skutecznością i odpowiedzialnością.

Raport ten przedstawiany jest Zarządowi i Radzie Nadzorczej.

## V. FUNDUSZE WŁASNE

- a) **Pełne uzgodnienie pozycji kapitału podstawowego Tier I, pozycji dodatkowych Tier I, pozycji Tier II, jak również filtrów i odliczeń stosowanych na mocy przepisów art.32-35, 36, 56, 66 oraz 79 w odniesieniu do funduszy własnych oraz bilansu w zbadanym sprawozdaniu finansowym na dzień 31 grudnia 2017 roku:**

Wiersze	Nr identyfikacyjny	Pozycja	Kwota
10	1	FUNDUSZE WŁASNE	1 908 271,58
15	1.1	KAPITAŁ TIER I	1 908 271,58
20	1.1.1	KAPITAŁ PODSTAWOWY TIER I	1 908 271,58
30	1.1.1.1	Instrumenty kapitałowe kwalifikujące się jako kapitał podstawowy Tier I	9 042 500,00
40	1.1.1.1.1	Opłacone instrumenty kapitałowe	8 723 000,00
45	1.1.1.1.1*	W tym: instrumenty kapitałowe subskrybowane przez organy publiczne w sytuacjach nadzwyczajnych	0,00
50	1.1.1.1.2*	Pozycja uzupełniająca: nieuznane instrumenty kapitałowe	0,00
60	1.1.1.1.3	Ażio	319 500,00
70	1.1.1.1.4	(-) Instrumenty własne w kapitale podstawowym Tier I	0,00
80	1.1.1.1.4.1	(-) Bezpośrednie udziały kapitałowe w instrumentach w kapitale podstawowym Tier I	0,00
90	1.1.1.1.4.2	(-) Pośrednie udziały kapitałowe w instrumentach w kapitale podstawowym Tier I	0,00
91	1.1.1.1.4.3	(-) Syntetyczne udziały kapitałowe w instrumentach w kapitale podstawowym Tier I	0,00
92	1.1.1.1.5	(-) Faktyczne lub warunkowe zobowiązania do zakupu instrumentów własnych w kapitale podstawowym Tier I	0,00
130	1.1.1.2	Zyski zatrzymane	-2 984 228,42
140	1.1.1.2.1	Zyski zatrzymane w poprzednich latach	-285 213,74
150	1.1.1.2.2	Uznany zysk lub uznana strata	-2 699 014,68
160	1.1.1.2.2.1	Zysk lub strata możliwe do przypisania właścicielom jednostki dominującej	0,00
170	1.1.1.2.2.2	(-) Część nieuznanego zysku z bieżącego okresu lub nieuznanego zysku rocznego	0,00
180	1.1.1.3	Skumulowane inne całkowite dochody	0,00
200	1.1.1.4	Kapitał rezerwowy	0,00
210	1.1.1.5	Fundusze ogólne ryzyka bankowego	0,00
220	1.1.1.6	Korekty w okresie przejściowym z tytułu instrumentów w kapitale podstawowym Tier I podlegających zasadzie praw nabytych	0,00
230	1.1.1.7	Udział mniejszości ujęty w kapitale podstawowym Tier I	0,00
240	1.1.1.8	Korekty w okresie przejściowym z tytułu dodatkowych udziałów mniejszości	0,00
250	1.1.1.9	Korekty w kapitale podstawowym Tier I z tytułu filtrów ostrożnościowych	0,00

260	1.1.1.9.1	(-) Zwiększenia kapitału własnego z tytułu aktywów sekurytyzowanych	0,00
270	1.1.1.9.2	Rezerwa z tytułu instrumentów zabezpieczających przepływy pieniężne	0,00
280	1.1.1.9.3	Skumulowane zyski i straty spowodowane zmianami własnego ryzyka kredytowego w zakresie zobowiązań wycenionych według wartości godziwej	0,00
285	1.1.1.9.4	Zyski i straty wycenione według wartości godziwej, wynikające z własnego ryzyka kredytowego instytucji związanego z zobowiązaniami będącymi instrumentami pochodnymi	0,00
290	1.1.1.9.5	(-) Korekty wartości z tytułu wymogów w zakresie ostrożnej wyceny	0,00
300	1.1.1.10	(-) Wartość firmy	-4 150 000,00
310	1.1.1.10.1	(-) Wartość firmy rozliczana jako aktywa niematerialne i prawne	-0,00
320	1.1.1.10.2	(-) Wartość firmy uwzględniona w wycenie znacznych inwestycji	0,00
330	1.1.1.10.3	Rezerwy z tytułu odroczonego podatku dochodowego związane z wartością firmy	0,00
340	1.1.1.11	(-) Inne wartości niematerialne i prawne	-126 300,81
350	1.1.1.11.1	(-) Kwota brutto innych wartości niematerialnych i prawnych	-126 300,81
360	1.1.1.11.2	Rezerwy z tytułu odroczonego podatku dochodowego związane z innymi aktywami niematerialnymi i prawnymi	0,00
370	1.1.1.12	(-) Aktywa z tytułu odroczonego podatku dochodowego oparte na przyszłej rentowności i niewynikające z różnic przejściowych po odliczeniu powiązanych rezerw z tytułu podatku dochodowego	0,00
380	1.1.1.13	(-) Niedobór korekt ryzyka kredytowego wobec oczekiwanych strat według metody IRB	0,00
390	1.1.1.14	(-) Aktywa funduszu emerytalnego ze zdefiniowanymi świadczeniami	0,00
400	1.1.1.14.1	(-) Kwota brutto aktywów funduszu emerytalnego ze zdefiniowanymi świadczeniami	0,00
410	1.1.1.14.2	Rezerwy z tytułu odroczonego podatku dochodowego związane z aktywami funduszu emerytalnego ze zdefiniowanymi świadczeniami	0,00
420	1.1.1.14.3	Aktywa funduszu emerytalnego ze zdefiniowanymi świadczeniami, które instytucja może wykorzystywać w nieograniczony sposób	0,00
430	1.1.1.15	(-) Krzyżowe powiązania kapitałowe w kapitale podstawowym Tier I	0,00
440	1.1.1.16	(-) Nadwyżka odliczenia od pozycji dodatkowych w Tier I ponad kapitał podstawowy Tier I	0,00
450	1.1.1.17	(-) Znaczące pakiety akcji poza sektorem finansowym, które alternatywnie mogą podlegać stosowaniu wagi ryzyka 1250 %	0,00
460	1.1.1.18	(-) Pozycje sekurytyzacyjne, które alternatywnie mogą podlegać stosowaniu wagi ryzyka 1250 %	0,00
470	1.1.1.19	(-) Dostawy z późniejszym terminem rozliczenia, które alternatywnie mogą podlegać stosowaniu wagi ryzyka 1250 %	0,00
471	1.1.1.20	(-) Pozycje w koszyku, w odniesieniu do których instytucja nie może określić wagi ryzyka przy zastosowaniu metody IRB oraz które alternatywnie mogą podlegać stosowaniu wagi ryzyka 1250 %	0,00

472	1.1.1.21	(-) Ekspozycje kapitałowe przy zastosowaniu metody modeli wewnętrznych, które alternatywnie mogą podlegać stosowaniu wagi ryzyka 1 250 %	0,00
480	1.1.1.22	(-) Instrumenty w kapitale podstawowym Tier I podmiotów sektora finansowego, jeżeli instytucja nie dokonała znacznej inwestycji w te podmioty	0,00
490	1.1.1.23	(-) Aktywa z tytułu odroczonego podatku dochodowego oparte na przyszłej rentowności i wynikające z różnic przejściowych	0,00
500	1.1.1.24	(-) Instrumenty w kapitale podstawowym Tier I podmiotów sektora finansowego, jeżeli instytucja dokonała znacznej inwestycji w te podmioty	0,00
510	1.1.1.25	(-) Kwota przekraczająca próg 17,65 %	0,00
520	1.1.1.26	Inne korekty w okresie przejściowym w kapitale podstawowym Tier I	0,00
524	1.1.1.27	(-) Dodatkowe odliczenia od kapitału podstawowego Tier I zgodnie z art. 3 CRR	0,00
529	1.1.1.28	Elementy kapitału podstawowego Tier I lub odliczenia od kapitału podstawowego Tier I – inne	0,00
530	1.1.2	KAPITAŁ DODATKOWY TIER I	0,00
540	1.1.2.1	Instrumenty kapitałowe kwalifikujące się jako kapitał dodatkowy Tier I	0,00
550	1.1.2.1.1	Opłacone instrumenty kapitałowe	0,00
560	1.1.2.1.2*	Pozycja uzupełniająca: nieuznane instrumenty kapitałowe	0,00
570	1.1.2.1.3	Azio	0,00
580	1.1.2.1.4	(-) Instrumenty własne w kapitale dodatkowym Tier I	0,00
590	1.1.2.1.4.1	(-) Bezpośrednie udziały kapitałowe w instrumentach w kapitale dodatkowym Tier I	0,00
620	1.1.2.1.4.2	(-) Pośrednie udziały kapitałowe w instrumentach w kapitale dodatkowym Tier I	0,00
621	1.1.2.1.4.3	(-) Syntetyczne udziały kapitałowe w instrumentach w kapitale dodatkowym Tier I	0,00
622	1.1.2.1.5	(-) Faktyczne lub warunkowe zobowiązania do zakupu instrumentów własnych w kapitale dodatkowym Tier I	0,00
660	1.1.2.2	Korekty w okresie przejściowym z tytułu instrumentów w kapitale dodatkowym Tier I podlegających zasadzie praw nabytych	0,00
670	1.1.2.3	Instrumenty emitowane przez jednostki zależne ujmowane w kapitale dodatkowym Tier I	0,00
680	1.1.2.4	Korekty w okresie przejściowym z tytułu dodatkowego ujęcia instrumentów emitowanych przez jednostki zależne w kapitale dodatkowym Tier I	0,00
690	1.1.2.5	(-) Krzyżowe powiązania kapitałowe w kapitale dodatkowym Tier I	0,00
700	1.1.2.6	(-) Instrumenty w kapitale dodatkowym Tier I podmiotów sektora finansowego, jeżeli instytucja nie dokonała znacznej inwestycji w te podmioty	0,00
710	1.1.2.7	(-) Instrumenty w kapitale dodatkowym Tier I podmiotów sektora finansowego, jeżeli instytucja dokonała znacznej inwestycji w te podmioty	0,00
720	1.1.2.8	(-) Nadwyżka odliczenia od pozycji w Tier II ponad kapitał Tier II	0,00
730	1.1.2.9	Inne korekty w okresie przejściowym w kapitale dodatkowym Tier I	0,00

740	1.1.2.10	Nadwyżka odliczenia od pozycji dodatkowych w Tier I ponad kapitał dodatkowy Tier I (odliczenie w kapitale podstawowym Tier I)	0,00
744	1.1.2.11	(-) Dodatkowe odliczenia od kapitału dodatkowego Tier I zgodnie z art. 3 CRR	0,00
748	1.1.2.12	Elementy kapitału dodatkowego Tier I lub odliczenia od kapitału dodatkowego Tier I – inne	0,00
750	1.2	KAPITAŁ TIER II	0,00
760	1.2.1	Instrumenty kapitałowe i pożyczki podporządkowane kwalifikujące się jako kapitał Tier II	0,00
770	1.2.1.1	Opłacone instrumenty kapitałowe i pożyczki podporządkowane	0,00
780	1.2.1.2*	Pozycja uzupełniająca: nieuznane instrumenty kapitałowe i pożyczki podporządkowane	0,00
790	1.2.1.3	Ażio	0,00
800	1.2.1.4	(-) Instrumenty własne w kapitale Tier II	0,00
810	1.2.1.4.1	(-) Bezpośrednie udziały kapitałowe w instrumentach w kapitale Tier II	0,00
840	1.2.1.4.2	(-) Pośrednie udziały kapitałowe w instrumentach w kapitale Tier II	0,00
841	1.2.1.4.3	(-) Syntetyczne udziały kapitałowe w instrumentach w kapitale Tier II	0,00
842	1.2.1.5	(-) Faktyczne lub warunkowe zobowiązania do zakupu instrumentów własnych w kapitale Tier II	0,00
880	1.2.2	Korekty w okresie przejściowym z tytułu instrumentów w kapitale Tier II oraz pożyczek podporządkowanych podlegających zasadzie praw nabytych	0,00
890	1.2.3	Instrumenty emitowane przez jednostki zależne uznane w kapitale Tier II	0,00
900	1.2.4	Korekty w okresie przejściowym z tytułu dodatkowego uznania instrumentów emitowanych przez jednostki zależne w kapitale Tier II	0,00
910	1.2.5	Nadwyżka rezerw ponad oczekiwane uznane straty według metody IRB	0,00
920	1.2.6	Korekty z tytułu ogólnego ryzyka kredytowego według metody standardowej	0,00
930	1.2.7	(-) Krzyżowe powiązania kapitałowe w kapitale Tier II	0,00
940	1.2.8	(-) Instrumenty w kapitale Tier II podmiotów sektora finansowego, jeżeli instytucja nie dokonała znacznej inwestycji	0,00
950	1.2.9	(-) Instrumenty w kapitale Tier II podmiotów sektora finansowego, jeżeli instytucja dokonała znacznej inwestycji	0,00
960	1.2.10	Inne korekty w okresie przejściowym w kapitale Tier II	0,00
970	1.2.11	Nadwyżka odliczenia od pozycji w Tier II ponad kapitał Tier II (odliczenie w kapitale dodatkowym Tier I)	0,00
974	1.2.12	(-) Dodatkowe odliczenia od kapitału Tier II zgodnie z art. 3 CRR	0,00
978	1.2.13	Elementy kapitału Tier II lub odliczenia od kapitału Tier II – inne	0,00

**b) Opis głównych cech instrumentów w kapitale podstawowym Tier I i instrumentów dodatkowych w Tier I oraz instrumentów w kapitale Tier II**

Główne cechy instrumentów kapitałowych		
1	Emitent	EFIX Dom Maklerski S.A.
2	Unikatowy identyfikator ( np. CUSIP, ISIN lub identyfikator Bloomberg dla ofert na rynku niepublicznym)	Kod ISIN: PLEFIX000012
3	Prawo lub prawa właściwe, którym podlega instrument	Polskie
<i>Ujmowanie w kapitale regulacyjnym</i>		
4	Zasady przejściowe określone w rozporządzeniu CRR	Kapitał podstawowy Tier I
5	Zasady określone w rozporządzeniu CRR obowiązujące po okresie przejściowym	Kapitał podstawowy Tier I
6	Kwalifikowalne na poziomie jednostkowym lub (sub-)skonsolidowanym/na poziomie jednostkowym oraz (sub-)skonsolidowanym	Poziom jednostkowy
7	Rodzaj instrumentu (rodzaje określone przez każdy system prawny)	Rodzaj instrumentu: akcje serii A imienne założycielskie, akcje imienne uprzywilejowane co do głosu na Walnym Zgromadzeniu x 2 (seria A-C) i na okaziciela (seria D-G) Klasyfikacja - instrument w kapitale podstawowym Tier I zgodnie z art. 28 rozporządzenia (UE) nr 575/2013.
	Kwota uznana w kapitale regulacyjnym (według stanu na ostatni dzień sprawozdawczy)	wartość nominalna: seria A - 550 000 zł seria B - 300 000 zł seria C - 6 000 000 zł seria D - 400 000 zł seria E - 273 000 zł seria F - 800 000 zł seria G - 400 000 zł agio: 319 500 zł wartość całkowita: seria A - 550 000 zł seria B - 300 000 zł seria C - 6 000 000 zł seria D - 400 000 zł seria E - 273 000 zł seria F - 1 119 500 zł seria G - 400 000 zł
9	Wartość nominalna instrumentów	8 723 000 zł



	<i>Cena emisyjna</i>	seria A - 10 zł seria B - 10 zł seria C - 10 zł seria D - 10 zł seria E - 10 zł seria F - 14 zł seria G - 14 zł
	<i>Cena wykupu</i>	nie dotyczy
10	Klasyfikacja księgowa	kapitał własny
11	Pierwotna data emisji	seria A - 8.01.2010 r. seria B - 27.04.2011 r. seria C - 01.09.2011 r. seria D - 28.06.2012 r., 06.07.2012 r., 11.07.2012 r., 30 -31.01.2013 r., 27.02.2013 r. seria E - 25- 27.03.2013 r., 10.04.2013 r. seria F - 05.02.2015 r. seria G - 15.03.2013 r.
12	Wieczyste czy terminowe	wieczyste
13	Pierwotny termin zapadalności	brak terminu zapadalności
14	Opcja wykupu na żądanie emitenta podlegająca wcześniejszemu zatwierdzeniu przez organy nadzoru	nie
15	Termin wykupu opcjonalnego, terminy wykupu warunkowego oraz kwota wykupu	nie dotyczy
16	Kolejne terminy wykupu, jeżeli dotyczy	nie dotyczy
<b><i>Kupony/dywidendy</i></b>		
17	Stała lub zmienna dywidenda / stały lub zmienny kupon	stopa zmienna dywidendy
18	Kupon odsetkowy oraz dowolny powiązany wskaźnik	nie dotyczy
19	Istnienie zapisanych praw do niewypłacenia dywidendy	tak
20a	W pełni uznaniowe, częściowo uznaniowe czy obowiązkowe (pod względem terminu) - w odniesieniu do wypłaty kuponu/dywidendy	częściowo uznaniowe m.in. z powodu wpływu polityki dywidendowej Komisji Nadzoru Finansowego i ewentualnych innych ograniczeń prawnych
20b	W pełni uznaniowe, częściowo uznaniowe czy obowiązkowe (pod względem kwoty) - w odniesieniu do wypłaty kuponu/dywidendy	częściowo uznaniowe m.in. z powodu wpływu polityki dywidendowej Komisji Nadzoru Finansowego i ewentualnych innych ograniczeń prawnych
21	Istnienie opcji z oprocentowaniem rosnącym lub innej zachęty do wykupu	nie dotyczy
22	Nieskumulowane czy skumulowane	nieskumulowane
23	Zamienne czy niezamienne	niezamienne

24	Jeżeli zamienne, zdarzenie lub zdarzenia wywołujące zamianę	nie dotyczy
25	Jeżeli zamienne, w pełni czy częściowo	nie dotyczy
26	Jeżeli zamienne, wskaźnik konwersji	nie dotyczy
27	Jeżeli zamienne, zamiana obowiązkowa czy opcjonalna	nie dotyczy
28	Jeżeli zamienne, należy określić rodzaj instrumentu, na który można dokonać zamiany	nie dotyczy
29	Jeżeli zamienne, należy określić emitenta instrumentu, na który dokonuje się zamiany	nie dotyczy
30	Odpisy obniżające wartość	nie
31	W przypadku odpisu obniżającego wartość, zdarzenie lub zdarzenia wywołujące odpis obniżający wartość	nie dotyczy
32	W przypadku odpisu obniżającego wartość, w pełni czy częściowo	nie dotyczy
33	W przypadku odpisu obniżającego wartość, trwale czy tymczasowo	nie dotyczy
34	W przypadku tymczasowego odpisu obniżającego wartość, opis mechanizmu odpisu obniżającego wartość	nie dotyczy
35	Pozycja w hierarchii podporządkowania w przypadku likwidacji (należy określić rodzaj instrumentu bezpośrednio uprzywilejowanego w odniesieniu do danego instrumentu)	nie dotyczy
36	Niezgodne cechy przejściowe	nie
37	Jeżeli tak, należy określić niezgodne cechy	nie dotyczy

**c) Pełne warunki dotyczące wszystkich instrumentów w kapitale podstawowym Tier I, instrumentów dodatkowych w Tier I oraz instrumentów w kapitale Tier II**

Opłacone instrumenty kapitałowe Domu Maklerskiego na dzień 31.12.2017 roku wynosiły 8.723.000zł i dzieliły się na 872.300 sztuk akcji o wartości nominalnej 10 zł każda.

Dom Maklerski nie posiada instrumentów kapitałowych kwalifikujących się, jako kapitał dodatkowy Tier I, jak również instrumentów kapitałowych i pasywów podporządkowanych kwalifikujących się, jako kapitał Tier II.

**d) Oddzielne informacje na temat charakteru i kwot poszczególnych pozycji oraz opis wszystkich ograniczeń zastosowanych do obliczania funduszy własnych zgodnie z CRR oraz instrumentów, filtrów ostrożnościowych i odliczeń, do których te ograniczenia mają zastosowanie**

Dom Maklerski nie stosuje ograniczeń do obliczania funduszy własnych zgodnie z Rozporządzeniem CRR oraz instrumentów, filtrów ostrożnościowych i odliczeń, do których te ograniczenia mają zastosowanie,

**e) Opis wszystkich ograniczeń zastosowanych do obliczania funduszy własnych zgodnie z Rozporządzeniem CRR oraz instrumentów, filtrów ostrożnościowych i odliczeń, do których te ograniczenia mają zastosowanie**

Dom Maklerski nie stosuje ograniczeń zastosowanych do obliczania funduszy własnych zgodnie z Rozporządzeniem CRR oraz instrumentów, filtrów ostrożnościowych i odliczeń, do których te ograniczenia mają zastosowanie.

**f) W przypadku, gdy instytucje ujawniają współczynniki kapitałowe obliczone z wykorzystaniem elementów funduszy własnych ustalonych na podstawie innej niż podstawa określona w Rozporządzeniu CRR- kompleksowe wyjaśnienie podstawy służącej do obliczania tych współczynników kapitałowych**

Dom Maklerski nie stosuje współczynników kapitałowych obliczonych z wykorzystaniem elementów funduszy własnych na podstawie innej niż podstawa określona w Rozporządzeniu CRR

## VI. Wymogi kapitałowe

1. Wymóg kapitałowy w zakresie funduszy własnych Dom Maklerski oblicza zgodnie z art. 95 ust. 2 Rozporządzenia CRR, na podstawie którego łączna kwota ekspozycji na ryzyko obliczana jest jako wyższa z dwóch następujących wartości:
  - sumy ekspozycji z tytułu stałych kosztów pośrednich poniesionych w roku poprzednim pomnożonej przez 12,5
  - suma ekspozycji na ryzyko kredytowe ważonych ryzykiem oraz ryzyko walutowe.

### a) Ryzyko kredytowe

Wiersz	Pozycja	Oznaczenie	Kwota
10	1	<b>ŁĄCZNA KWOTA EKSPOZYCJI NA RYZYKO</b>	8 997 418,38
20	1*	w tym: firmy inwestycyjne, o których mowa w art. 95 ust. 2 oraz w art. 98 CRR	0,00
30	1**	w tym: firmy inwestycyjne, o których mowa w art. 96 ust. 2 oraz w art. 97 CRR	0,00
40	1.1	KWOTY EKSPOZYCJI WAŻONYCH RYZYKIEM W ODNIESIENIU DO RYZYKA KREDYTOWEGO, RYZYKA KREDYTOWEGO KONTRAHENTA, RYZYKA ROZMYCIA ORAZ DOSTAW Z PÓŹNIEJSZYM TERMINEM ROZLICZENIA	2 630 304,21
50	1.1.1	Metoda standardowa	2 630 304,21
60	1.1.1.1	Kategorie ekspozycji według metody standardowej z wyłączeniem pozycji sekurytyzacyjnych	2 630 304,21
70	1.1.1.1.01	Ekspozycje wobec rządów centralnych lub banków centralnych	0,00
80	1.1.1.1.02	Ekspozycje wobec samorządów regionalnych lub władz lokalnych	0,00
90	1.1.1.1.03	Ekspozycje wobec podmiotów sektora publicznego	0,00
100	1.1.1.1.04	Ekspozycje wobec wielostronnych banków rozwoju	0,00
110	1.1.1.1.05	Ekspozycje wobec organizacji międzynarodowych	0,00
120	1.1.1.1.06	Ekspozycje wobec instytucji	3 780,14
130	1.1.1.1.07	Ekspozycje wobec przedsiębiorstw	0,00
140	1.1.1.1.08	Ekspozycje detaliczne	0,00
150	1.1.1.1.09	Ekspozycje zabezpieczone hipotekami na nieruchomościach	0,00
160	1.1.1.1.10	Ekspozycje, których dotyczy niewykonanie zobowiązania	0,00
170	1.1.1.1.11	Pozycje związane ze szczególnie wysokim ryzykiem	0,00
180	1.1.1.1.12	Obligacje zabezpieczone	0,00
190	1.1.1.1.13	Ekspozycje z tytułu należności od instytucji i przedsiębiorstw posiadających krótkoterminową ocenę kredytową	0,00
200	1.1.1.1.14	Przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania	0,00
210	1.1.1.1.15	Akcje	2 111 037,22

211	1.1.1.1.16	Inne pozycje	515 486,85
220	1.1.1.2	Pozycje stanowiące pozycje sekurytyzacyjne według metody standardowej	0,00
230	1.1.1.2*	w tym: resekurytyzacja	0,00
240	1.1.2	Metoda wewnętrznych ratingów (IRB)	0,00
250	1.1.2.1	Metody IRB w przypadku gdy nie są stosowane własne oszacowania LGD ani współczynniki konwersji	0,00
260	1.1.2.1.01	Ekspozycje wobec rządów centralnych i banków centralnych	0,00
270	1.1.2.1.02	Ekspozycje wobec instytucji	0,00
280	1.1.2.1.03	Ekspozycje wobec przedsiębiorstw - MŚP	0,00
290	1.1.2.1.04	Ekspozycje wobec przedsiębiorstw - kredytowanie specjalistyczne	0,00
300	1.1.2.1.05	Ekspozycje wobec przedsiębiorstw - inne	0,00
310	1.1.2.2	Metody IRB w przypadku gdy stosowane są oszacowania własne LGD lub współczynniki konwersji	0,00
320	1.1.2.2.01	Ekspozycje wobec rządów centralnych i banków centralnych	0,00
330	1.1.2.2.02	Ekspozycje wobec instytucji	0,00
340	1.1.2.2.03	Ekspozycje wobec przedsiębiorstw - MŚP	0,00
350	1.1.2.2.04	Ekspozycje wobec przedsiębiorstw - kredytowanie specjalistyczne	0,00
360	1.1.2.2.05	Ekspozycje wobec przedsiębiorstw - inne	0,00
370	1.1.2.2.06	Ekspozycje detaliczne - wobec MŚP zabezpieczone nieruchomością	0,00
380	1.1.2.2.07	Ekspozycje detaliczne - wobec przedsiębiorstw niebędących MŚP zabezpieczone nieruchomością	0,00
390	1.1.2.2.08	Kwalifikowane odnawialne ekspozycje detaliczne	0,00
400	1.1.2.2.09	Ekspozycje detaliczne - inne ekspozycje wobec MŚP	0,00
410	1.1.2.2.10	Ekspozycje detaliczne - inne ekspozycje wobec przedsiębiorstw niebędących MŚP	0,00
420	1.1.2.3	Ekspozycje kapitałowe według metody IRB	0,00
430	1.1.2.4	Pozycje sekurytyzacyjne według metody IRB	0,00
440	1.1.2.4*	w tym: resekurytyzacja	0,00
450	1.1.2.5	Inne aktywa niegenerujące zobowiązania kredytowego	0,00
460	1.1.3	Kwota ekspozycji na ryzyko z tytułu wkładu do funduszu kontrahenta centralnego na wypadek niewykonania zobowiązania	0,00
490	1.2	ŁĄCZNA KWOTA EKSPOZYCJI NA RYZYKO ROZLICZENIA/DOSTAWY	0,00
500	1.2.1	Ryzyko rozliczenia/dostawy w portfelu bankowym	0,00
510	1.2.2	Ryzyko rozliczenia/dostawy w portfelu handlowym	0,00
520	1.3	ŁĄCZNA KWOTA EKSPOZYCJI NA RYZYKO Z TYTUŁU RYZYKA POZYCJI, RYZYKA WALUTOWEGO I RYZYKA CEN TOWARÓW	0,00
530	1.3.1	Kwota ekspozycji na ryzyko z tytułu ryzyka pozycji, ryzyka walutowego i ryzyka cen towarów według metod standardowych	0,00
540	1.3.1.1	Rynkowe instrumenty dłużne	0,00
550	1.3.1.2	Akcje	0,00
555	1.3.1.3	Szczególna metoda stosowana w odniesieniu do ryzyka pozycji w przedsiębiorstwach zbiorowego inwestowania	0,00
556	1.3.1.3*	Pozycja uzupełniająca: Przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania, które zainwestowały wyłącznie w rynkowe instrumenty dłużne	0,00
557	1.3.1.3**	Pozycja uzupełniająca: Przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania, które zainwestowały wyłącznie w instrumenty udziałowe lub w instrumenty mieszane	0,00
560	1.3.1.4	Ryzyko walutowe	0,00
570	1.3.1.5	Ryzyko cen towarów	0,00
580	1.3.2	Kwota ekspozycji na ryzyko z tytułu ryzyka pozycji, ryzyka walutowego i ryzyka cen towarów według modeli wewnętrznych	0,00

590	1.4	ŁĄCZNA KWOTA EKSPozyCJI NA RYZYKO Z TYTUŁU RYZYKA OPERACYJNEGO	0,00
600	1.4.1	Ryzyko operacyjne według metody wskaźnika bazowego	0,00
610	1.4.2	Ryzyko operacyjne według metody standardowej/alternatywnej metody standardowej	0,00
620	1.4.3	Metody zaawansowanego pomiaru w odniesieniu do ryzyka operacyjnego	0,00
630	1.5	DODATKOWA KWOTA EKSPozyCJI NA RYZYKO Z TYTUŁU STAŁYCH KOSZTÓW POŚREDNICH	6 367 114,17
640	1.6	ŁĄCZNA KWOTA EKSPozyCJI NA RYZYKO Z TYTUŁU KOREKTY WYCENY KREDYTOWEJ	0,00
650	1.6.1	Metoda zaawansowana	0,00
660	1.6.2	Metoda standardowa	0,00
670	1.6.3	Na podstawie metody wyceny pierwotnej ekspozycji	0,00
680	1.7	ŁĄCZNA KWOTA EKSPozyCJI NA RYZYKO Z TYTUŁU DUŻYCH EKSPozyCJI W PORTFELU HANDLOWYM	0,00
690	1.8	KWOTY INNYCH EKSPozyCJI NA RYZYKO	0,00
710	1.8.2	w tym: z tytułu dodatkowych, surowszych wymogów ostrożnościowych na podstawie art. 458	0,00
720	1.8.2*	w tym: z tytułu wymogów dotyczących dużych ekspozycji	0,00
730	1.8.2**	w tym: z tytułu zmodyfikowanych wag ryzyka w odniesieniu do baniek spekulacyjnych dotyczących sektora nieruchomości mieszkalnych i komercyjnych	0,00
740	1.8.2***	w tym: z tytułu ekspozycji wewnątrz sektora finansowego	0,00
750	1.8.3	w tym: z tytułu dodatkowych, surowszych wymogów ostrożnościowych na podstawie art. 459	0,00
760	1.8.4	w tym: dodatkowa kwota ekspozycji na ryzyko wynikająca z art. 3 CRR	

### Poziom ekspozycji na ryzyko

POZYCJA	ŁĄCZNA KWOTA EKSPozyCJI NA RYZYKO	KWOTY EKSPozyCJI WAŻONYCH RYZYKIEM W ODNIESIENIU DO RYZYKA KREDYTOWEGO, RYZYKA KREDYTOWEGO KONTRAHENTA, RYZYKA ROZMYCIA ORAZ DOSTAW Z PÓŹNIEJSZYM TERMINEM ROZLICZENIA	DODATKOWA KWOTA EKSPozyCJI NA RYZYKO Z TYTUŁU STAŁYCH KOSZTÓW POŚREDNICH	Fundusze własne oparte na stałych kosztach pośrednich	Odchylenie wysokości funduszy własnych od wartości wymogu z tytułu kosztów stałych
<b>dzień bilansowy 31/12/2017</b>	8 997 418,38	2 630 304,21	6 367 114,17	719 793,47	1 188 478,11
<b>gru-17</b>	8 997 418,38	2 990 765,24	6 006 653,14	719 793,47	1 598 543,93
<b>lis-17</b>	8 997 418,38	3 480 963,54	5 516 454,84	719 793,47	2 126 701,50
<b>paź-17</b>	8 997 418,38	3 647 398,98	5 350 019,39	719 793,47	2 299 963,80
<b>wrz-17</b>	8 997 418,38	3 694 655,46	5 302 762,91	719 793,47	2 424 637,42
<b>sie-17</b>	8 997 418,38	3 704 261,89	5 293 156,48	719 793,47	2 522 677,17
<b>lip-17</b>	8 997 418,38	3 764 582,02	5 232 836,36	719 793,47	2 603 920,36

<b>cze-17</b>	8 997 418,38	3 876 851,78	5 120 566,60	719 793,47	2 735 498,41
<b>maj-17</b>	8 997 418,38	3 887 337,97	5 110 080,40	719 793,47	2 925 680,53
<b>kwi-17</b>	8 997 418,38	3 849 745,57	5 147 672,81	719 793,47	3 081 294,43
<b>mar-17</b>	18 293 404,88	3 898 091,67	14 395 313,20	1 463 472,39	2 463 691,06
<b>lut-17</b>	18 293 404,88	3 915 513,74	14 377 891,14	1 463 472,39	2 605 743,66
<b>sty-17</b>	18 293 404,88	3 911 885,84	14 381 519,04	1 463 472,39	2 754 845,45
<b>poprzedni dzień bilansowy 31/12/2016</b>	18 293 404,88	3 936 262,80	14 357 142,07	1 463 472,39	2 843 666,88

### Współczynniki kapitałowe

POZYCJA	Współczynnik kapitału podstawowego Tier I	Nadwyżka(+)/niedobór(-) kapitału podstawowego Tier I	Współczynnik kapitału Tier I	Nadwyżka(+)/niedobór(-) kapitału Tier I	Łączny współczynnik kapitałowy	Nadwyżka (+)/niedobór (-) łącznego kapitału
<b>dzień bilansowy 31/12/2017</b>	21,21%	1 503 387,75	21,21%	1 368 426,48	21,21%	1 188 478,11
<b>gru-17</b>	25,77%	1 913 453,57	25,77%	1 778 492,29	25,77%	1 598 543,93
<b>lis-17</b>	31,64%	2 441 611,14	31,64%	2 306 649,86	31,64%	2 126 701,50
<b>paź-17</b>	33,56%	2 614 873,44	33,56%	2 479 912,16	33,56%	2 299 963,80
<b>wrz-17</b>	34,95%	2 739 547,06	34,95%	2 604 585,79	34,95%	2 424 637,42
<b>sie-17</b>	36,04%	2 837 586,81	36,04%	2 702 625,54	36,04%	2 522 677,17
<b>lip-17</b>	36,94%	2 918 830,00	36,94%	2 783 868,72	36,94%	2 603 920,36
<b>cze-17</b>	38,40%	3 050 408,05	38,40%	2 915 446,77	38,40%	2 735 498,41
<b>maj-17</b>	40,52%	3 240 590,17	40,52%	3 105 628,89	40,52%	2 925 680,53

### Ekspozycja na ryzyko kredytowe kontrahenta

Dom Maklerski nie posiadał w 2017 roku ekspozycji skutkujących powstaniem ryzyka rozliczenia dostawy i ryzyka kredytowego kontrahenta.

### Bufory kapitałowe

Nie były stosowane.

### Wskaźniki globalnego znaczenia systemowego

Dom Maklerski nie posiada statusu globalnej instytucji o znaczeniu systemowym, w związku z czym przedmiotowe wskaźniki nie dotyczą Domu Maklerskiego.

### Korekty z tytułu ryzyka kredytowego

Dom Maklerski nie dokonywał korekt z tytułu ryzyka kredytowego.

Dom Maklerski w odniesieniu do należności przeterminowanych i z rozpoznawalną trwałą utratą wartości stosuje się do ustawy o rachunkowości z dnia 29 września 1994 r.

### Aktywa wolne od obciążeń

Dom Maklerski nie posiadał aktywów obciążonych.

**Korzystanie z ECAI**

Dom Maklerski nie korzystał z ocen wiarygodności kredytowej sporządzanych przez zewnętrzne podmioty.

**Ekspozycje na ryzyko rynkowe**

Dom Maklerski nie posiadał ekspozycji skutkujących powstaniem ryzyka rynkowego.

**Ekspozycje w papierach kapitałowych nieuwzględnionych w portfelu handlowym**

Dom Maklerski posiadał na dzień 31 grudnia 2017 roku następujące ekspozycje w papierach kapitałowych nieuwzględnionych w portfelu handlowym o łącznej wartości bilansowej 2 111 037,22 PLN:

- 2.111.037,22 PLN spółki EFIX DATA sp. z o.o
- 0,00 PLN spółki Tradebox S.A.

Wycenił akcje i udziały przy zastosowaniu wartości godziwej.

**Ekspozycje na ryzyko stopy procentowej przypisane pozycjom nieuwzględnionym w portfelu handlowym**

Dom Maklerski nie posiadał takich ekspozycji.

**Ekspozycje na ryzyko sekurytyzacyjne**

Dom Maklerski nie posiadał takich ekspozycji.

**Polityka wynagrodzeń**

Dom Maklerski opracował i wdrożył politykę wynagrodzeń osób mających wpływ na profil ryzyka. Polityka wynagrodzeń nie przewiduje zmiennych składników wynagrodzeń zależnych od wyników.

Za aktualizację polityki zmiennych składników wynagrodzeń osób zajmujących stanowiska kierownicze odpowiedzialny jest Zarząd Domu Maklerskiego. Realizacja polityki zmiennych składników wynagrodzeń podlega co najmniej raz w roku przeglądowi. Przegląd dokonywany jest przez audyt wewnętrzny, na podstawie którego sporządzany jest pisemny raport określający stan realizacji polityki wynagrodzeń. Raport przedstawiany jest Radzie Nadzorczej.

**Wynagrodzenie kluczowego personelu kierowniczego**

WYNAGRODZENIE CZŁONKÓW ZARZĄDU I CZŁONKÓW ORGANÓW NADZORCZYCH	31.12.2017	31.12.2016
Wynagrodzenie brutto Członków Zarządu	283 598,90	276 669,88
Wynagrodzenie brutto Członków Rady Nadzorczej	4 000,00	4 500,00

**Dźwignia finansowa**

Dom Maklerski nie stosował dźwigni finansowej – zgodnie z Rozporządzeniem CRR Dom Maklerski podlega wyłączeniu w tym zakresie.

**Metoda IRB**

Dom Maklerski nie stosował zaawansowanych metod, w tym metody IRB w odniesieniu do ryzyka kredytowego.

**Techniki ograniczenia ryzyka kredytowego**

Dom Maklerski nie stosował technik ograniczenia ryzyka kredytowego.

**Metody zaawansowanego pomiaru w odniesieniu do ryzyka operacyjnego**

Dom Maklerski nie stosował metod zaawansowanego pomiaru ryzyka operacyjnego.

**Wewnętrzne modele pomiaru ryzyka rynkowego**

Dom Maklerski nie stosował wewnętrznych modeli pomiaru ryzyka rynkowego.

**Poznań, dnia 11 czerwca 2018 roku**

**Tomasz Korecki - Prezes Zarządu**

**Tomasz Marek - Członek Zarządu**