

## 2011. ÉVI KOCKÁZATI JELENTÉS

A 2012. február 03-án készített kockázatossági vizsgálat alapján megállapítható :

### I. HITEL ÉS PARTNERKOCKÁZAT :

- 1 A CEE Active Asset Management Zrt. partnereivel és ügyfeleivel kapcsolatosan Limit túllépés a vizsgált időszakra vonatkozóan nem történt. Ennek ellenőrizhetősége a P:/BO/LIMITEK ELLENORZESE/2011 mappában elmentett (napi rendszerességgel nyomtatott), napi gyakoriságú riportok alapján biztosított.  
A limitek (partner és ügyfél) megállapítása és felülvizsgálata az előírtaknak megfelelően megtörtént.
- 2 a CEE Active Asset Management Zrt-nél halasztott fizetés nem történt a vizsgált időszakban, így hitel kockázat nem merült fel.

### II. PIACI ÉS LIKVIDITÁSI KOCKÁZAT :

- 1 A P:/BO/SETTLEMENT RISK mappában található (napi rendszerességgel frissített) Nem teljesülési lista alapján megállapítható, hogy a nem teljesítéssel kapcsolatban március és június hónapokon kívül valamennyi hónapra vonatkozóan Társaságunknak volt kockázata, de ezzel kapcsolatban veszteség elszámolására nem került sor, minden ügylet le lett zárva, az eredeti paraméterek alapján.  
Év végén folyamatban lévő, elszámolatlan, vagy elszámolás alatt lévő tétel nem volt.
- 2 A társaság kiemelt figyelmet fordít a folyamatos likviditásra, így heti likviditási kimutatást készít, folyamatos működése alapján a pénzeszközeinek, a működéshez nem szükséges részét rövid távú lekötött betétben tartja. A CEE Active Asset Management Zrt-nek, a vizsgált időszakban lejárt esedékességű tartozása nem keletkezett.

### III. JOGI ÉS MŰKÖDÉSI KOCKÁZAT :

- 1 A CEE Active Asset Management Zrt. a jogi kockázatainak mérséklésére külső jogi képviselőt alkalmaz.
- 2 A Társaságnál aktív vezetői ellenőrzési rendszer működik (a vezetői ellenőrzések eredményeinek kivonatát a decemberi felügyelő bizottsági ülés elfogadta) a kötelező belső ellenőrzési rendszeren kívül, így a működési kockázatok a lehető legalacsonyabb szinten tarthatóak.

Fentiekén túl egyéb kockázatok nem kerültek azonosításra.

Kijelenthető, hogy a Társaság munkatársai a kockázatokat (a kockázatkezelési szabályzatban foglaltaknak megfelelően) folyamatosan figyelemmel kísérték, mindent megtettek a felmerülő kockázatok mérséklésére, kezelésére, ennek eredményeképpen a CEE Active Asset Management Zrt.-nek, kockázatokból eredő veszteséget nem kellett elszámolnia.

Társaságunknál a senior pénzügyi munkatárs (a kockázatkezelési szabályzat alapján) havonta készít kockázati jelentést.

Jelen kockázati jelentés az Igazgatóság és a Felügyelő Bizottság részére készült.

Budapest, 2012. május 22.



**Paunoch Róbert**  
Senior Pénzügyi munkatárs

**A Társaság szavatoló tőkéje 2011. december 31-i fordulónapra**

MEGNEVEZÉS	ÖSSZEG e.HUF
1 <b>Jegyzett tőke</b>	<b>60 000</b>
2 <b>Tartalékok</b>	<b>5 392</b>
<i>a, Eredménytartalék</i>	<i>2 894</i>
<i>b, Könyvvizsgált Mérleg Szerinti Eredmény</i>	<i>2 498</i>
3 <b>Levonások</b>	<b>275</b>
<i>a, Immateriális javak</i>	<i>275</i>
<b>Kockázatok Fedezetéül szolgáló Szavatoló Tőke</b>	<b><u>65 117</u></b>

**A Társaság 2011. december 31-i fordulónapon fennálló Tőkekövetelménye**

1 Hitelezési kockázattal kapcsolatban	9 844
2 Működési kockázattal kapcsolatban	16 321
3 Devizakockázattal kapcsolatban	31 266
<b>Összes Tőkekövetelmény</b>	<b>57 431</b>

**A Társaság Szavatoló Tőke többlete 2011. december 31-én : 7.686 e. HUF.**