

Warszawa, dnia 12 lipca 2021 r.

Oświadczenie Zarządu PGE Domu Maklerskiego S.A.

Ogólny profil ryzyka występującego w działalności PGE Domu Maklerskiego S.A. związany jest z jego podstawową działalnością operacyjną polegającą na wykonywaniu zleceń na rachunek klienta.

Strategia w zakresie zabezpieczenia i ograniczania ryzyka w PGE Dom Maklerski S.A. obejmuje następująca elementy:

- 1) system zarządzania ryzykiem funkcjonuje w Domu Maklerskim na podstawie zatwierdzonych procedur wewnętrznych,
- 2) Dom Maklerski zarządza ryzykiem poprzez identyfikowanie ryzyk, pomiar, monitorowanie oraz kontrolowanie poszczególnych istotnych rodzajów ryzyka związanych z prowadzoną działalnością,
- 3) Dom Maklerski ocenia zidentyfikowane ryzyka pod kątem istotności. Jeśli ryzyko zostanie uznane za istotne podlega monitorowaniu, pomiarowi oraz ocenie,
- 4) Zarząd oraz pracownicy Domu Maklerskiego są zobowiązani do przestrzegania obowiązujących zasad zarządzania ryzykiem w codziennym podejmowaniu decyzji,
- 5) Dom Maklerski koncentruje się na produktach w zakresie, których posiada doświadczenie umożliwiające rzetelną ocenę ryzyka,
- 6) wprowadzenie nowych produktów lub zmiana prowadzonej działalności poprzedzone są kompleksową oceną ryzyka,

7) wdrożony system raportowania w zakresie ryzyka dostarcza osobom odpowiedzialnym za podejmowanie decyzji informacji w zakresie ekspozycji na ryzyka istotne,

8) system zarządzania ryzykiem podlega regularnym weryfikacjom i niezbędnym aktualizacjom w celu zapewnienia adekwatności w stosunku do skali i złożoności prowadzonej przez Dom Maklerski działalności.

Kluczowe wskaźniki i dane liczbowe:

Tabela 1. Fundusze własne na dzień 31 grudnia 2020 roku

Fundusze własne	93 312 278,73 zł
Kapitał TIER I	93 312 278,73 zł
Kapitał podstawowy TIER I	93 312 278,73 zł

Tabela 2. Wartość kapitał wewnętrzny na dzień 31 grudnia 2020 roku

kategoria ryzyka	wartość końcowa
Ryzyko operacyjne	15 878 980,00 zł
Ryzyko kredytowe	19 637 715,64 zł
Ryzyko płynności	12 922 514,14 zł
Ryzyko stopy procentowej w portfelu niehandlowym	860 350,46 zł
SUMA	49 299 560,24 zł

Tabela 3. Współczynniki kapitałowe PGE Domu Maklerskiego oraz wartość nadwyżki kapitałów na dzień 31 grudnia 2020 roku, a tolerancja na ryzyko

Współczynnik kapitału podstawowego Tier I	38,01%
Nadwyżka(+)/niedobór(-) kapitału podstawowego Tier I	82 266 063,68 zł
Współczynnik kapitału Tier I	38,01%
Nadwyżka(+)/niedobór(-) kapitału Tier I	78 583 992,00 zł
Łączny współczynnik kapitałowy	38,01%
Nadwyżka(+)/niedobór(-) łącznego kapitału	73 674 563,09 zł
Określony na 2020 rok poziom apetytu na ryzyko	14%

Podpisy członków Zarządu PGE Dom Maklerski S.A.

Wojciech Maryański	Prezes Zarządu
Rafał Kucharski	Wiceprezes Zarządu