

Warszawa, dnia 13 lipca 2020 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 2019 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 2019 roku**

<b>kategoria ryzyka</b>	<b>wartość końcowa</b>
Ryzyko operacyjne	12 680 000,00 zł
Ryzyko kredytowe	35 136 883,24 zł
Ryzyko płynności	9 032 685,87 zł
Ryzyko stopy procentowej w portfelu niehandlowym	1 045 351,07 zł
<b>SUMA</b>	<b>57 894 920,18 zł</b>

**Tabela 3. Współczynniki kapitałowe PGE Domu Maklerskiego oraz wartość nadwyżki kapitałów na dzień 31 grudnia 2019 roku, a tolerancja na ryzyko**

Współczynnik kapitału podstawowego Tier I	21,25%
Nadwyżka(+)/niedobór(-) kapitału podstawowego Tier I	73 547 781,91 zł
Współczynnik kapitału Tier I	21,25%
Nadwyżka(+)/niedobór(-) kapitału Tier I	66 959 616,30 zł
Łączny współczynnik kapitałowy	21,25%
Nadwyżka(+)/niedobór(-) łącznego kapitału	58 175 395,49 zł
Określony na 2019 rok poziom apetytu na ryzyko	14%

Podpisy członków Zarządu PGE Dom Maklerski S.A.

<b>Wojciech Maryański</b>	<b>Prezes Zarządu</b>
<b>Rafał Kucharski</b>	<b>Wiceprezes Zarządu</b>