

Warszawa dnia 2 lipca 2018 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 przyjmowaniu i 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 2017 roku

FUNDUSZE WŁASNE	89 998 350,46 zł
KAPITAŁ TIER I	89 998 350,46 zł
KAPITAŁ PODSTAWOWY TIER I	89 998 350,46 zł

Tabela 2. Wartość kapitał wewnętrzny na dzień 31 grudnia 2017 roku

kategoria ryzyka	wartość końcowa
Ryzyko operacyjne	14 200 000 zł
Ryzyko kredytowe	7 723 348,80 zł
Ryzyko płynności	902 000,00 zł
Ryzyko walutowe	345 430,55 zł
Ryzyko stopy procentowej w portfelu niehandlowym	1 572 267,01 zł
SUMA	24 743 046,36 zł

Tabela 3. Współczynniki kapitałowe PGE Domu Maklerskiego oraz wartość nadwyżki kapitałów na dzień 31 grudnia 2017 roku, a tolerancja na ryzyko

Współczynnik kapitału podstawowego Tier I	89,23%
Nadwyżka(+)/niedobór(-) kapitału podstawowego Tier I	85 459 662,08 zł
Współczynnik kapitału Tier I	89,23%
Nadwyżka(+)/niedobór(-) kapitału Tier I	83 946 765,95 zł
Łączny współczynnik kapitałowy	89,23%
Nadwyżka(+)/niedobór(-) łącznego kapitału	81 929 571,11 zł
Określony na 2017 rok poziom apetytu na ryzyko	11%

Podpisy członków Zarządu PGE Dom Maklerski S.A.

Maciej Trybuchowski	Prezes Zarządu
Rafał Kucharski	Wiceprezes Zarządu