

Warszawa, dnia 28 czerwca 2019 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 2018 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 2018 roku

kategoria ryzyka	wartość końcowa
Ryzyko operacyjne	12 200 000,00 zł
Ryzyko kredytowe	18 986 499,17 zł
Ryzyko płynności	100 000,00 zł
Ryzyko stopy procentowej w portfelu niehandlowym	1 848 695,03 zł
SUMA	33 135 194,20 zł

Tabela 3. Współczynniki kapitałowe PGE Domu Maklerskiego oraz wartość nadwyżki kapitałów na dzień 31 grudnia 2018 roku, a tolerancja na ryzyko

Współczynnik kapitału podstawowego Tier I	37,92%
Nadwyżka(+)/niedobór(-) kapitału podstawowego Tier I	79 318 444,68 zł
Współczynnik kapitału Tier I	37,92%
Nadwyżka(+)/niedobór(-) kapitału Tier I	75 758 476,08 zł
Łączny współczynnik kapitałowy	37,92%
Nadwyżka(+)/niedobór(-) łącznego kapitału	71 011 851,29 zł
Określony na 2018 rok poziom apetytu na ryzyko	11%

Podpisy członków Zarządu PGE Dom Maklerski S.A.

Wojciech Maryański	Prezes Zarządu
Rafał Kucharski	Wiceprezes Zarządu