



PGE Dom Maklerski S.A.
ul. Mysia 2
00-496 Warszawa
tel : 22 340 13 60
Fax: 22 622 27 49

Warszawa dnia 25 czerwca 2015

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 następujące elementy:

- 1) system zarządzania ryzykiem funkcjonuje na podstawie zatwierdzonych procedur wewnętrznych,
- 2) PGE Dom Maklerski S.A. zarządza ryzykiem poprzez identyfikowanie ryzyk, pomiar, monitorowanie oraz kontrolowanie poszczególnych istotnych rodzajów ryzyka związanych z prowadzoną działalnością,
- 3) PGE Dom Maklerski S.A. ocenia zidentyfikowane ryzyka pod kątem istotności. Jeśli ryzyko zostanie uznane za istotne podlega monitorowaniu, pomiarowi oraz ocenie,
- 4) Zarząd oraz pracownicy PGE Domu Maklerskiego S.A. są zobowiązani do przestrzegania obowiązujących zasad zarządzania ryzykiem w codziennym podejmowaniu decyzji,
- 5) PGE Dom Maklerski S.A. 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 PGE Dom Maklerski działalności.

Kluczowe wskaźniki i dane liczbowe:

Tabela 1. Fundusze własne na dzień 31 grudnia 2014 roku

FUNDUSZE WŁASNE	81 928 063,20 zł
KAPITAŁ TIER I	81 928 063,20 zł
KAPITAŁ PODSTAWOWY TIER I	81 928 063,20 zł

Tabela 2. Wartość kapitał wewnętrzny na dzień 31 grudnia 2014 roku

Kategoria ryzyka	wartość końcowa
Ryzyko operacyjne	2 800 000,00 zł
Ryzyko kredytowe	6 789 315,58 zł
Ryzyko płynności	1 500 000,00 zł
SUMA	11 089 315,58 zł

Tabela 3. Współczynniki kapitałowe PGE Domu Maklerskiego oraz wartość nadwyżki kapitałów na dzień 31 grudnia 2014 roku, a tolerancja na ryzyko

Współczynnik kapitału podstawowego Tier I	59,07%
Nadwyżka(+)/niedobór(-) kapitału podstawowego Tier I	75 687 125,70 zł
Współczynnik kapitału Tier I	59,07%
Nadwyżka(+)/niedobór(-) kapitału Tier I	73 606 813,20 zł
Łączny współczynnik kapitałowy	59,07%
Nadwyżka(+)/niedobór(-) łącznego kapitału	70 833 063,20 zł
Określony na 2014 rok poziom apetytu na ryzyko	11%

Podpisy członków Zarządu PGE Dom Maklerski S.A.

Robert Bański	Prezes Zarządu
Marek Król	Wiceprezes Zarządu