

Warszawa dnia 3 lipca 2017 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 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 2016 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 2016 roku

<b>kategoria ryzyka</b>	<b>wartość końcowa</b>
Ryzyko operacyjne	14 000 000 zł
Ryzyko kredytowe	8 018 888,45 zł
Ryzyko płynności	896 000 zł
Ryzyko walutowe	206 509,81 zł
Ryzyko stopy procentowej w portfelu niehandlowym	1 992 532,06 zł
<b>SUMA</b>	<b>25 113 930,31 zł</b>

**Tabela 3.** Współczynniki kapitałowe PGE Domu Maklerskiego oraz wartość nadwyżki kapitałów na dzień 31 grudnia 2016 roku, a tolerancja na ryzyko

Współczynnik kapitału podstawowego Tier I	87,53%
Nadwyżka(+)/niedobór(-) kapitału podstawowego Tier I	85 371 563,94 zł
Współczynnik kapitału Tier I	87,53%
Nadwyżka(+)/niedobór(-) kapitału Tier I	83 829 301,77 zł
Łączny współczynnik kapitałowy	87,53%
Nadwyżka(+)/niedobór(-) łącznego kapitału	81 772 952,21 zł
Określony na 2016 rok poziom apetytu na ryzyko	11%

Podpisy członków Zarządu PGE Dom Maklerski S.A.

<b>Agnieszka Wolanin</b>	<b>Wiceprezes Zarządu</b>
<b>Marek Król</b>	<b>Wiceprezes Zarządu</b>