# Приложение 9

к Положению о клиринговых участниках

К А Р Т А

**самооценки системы управления рисками**

\* В настоящей карте под Организацией понимается кандидат в клиринговые участники

|  |
| --- |
| 1. Уполномоченным органом государства, юридическим лицом которого является  Организация, подписан меморандум о взаимопонимании по вопросам консультаций, сотрудничества и обмена информацией IOSCO? |
|  |
| Ответить "да" или "нет" |
|  |
| 2. .Имеется ли у Организации система управления рисками? |
|  |
| Ответить "да" или "нет". |
| 3. Имеет ли Организация внутренние политики и процедуры по управлению агрегированным и отдельными видами рисков? |
|  |
| Ответить "да" или "нет". Если "да" – перечислить данные политики и процедуры |
| 4. Распространяется ли действие внутренних политик и процедур Организации по  управлению рисками на ее зарубежные дочерние организации, зависимые акционерные общества, филиалы, представительства (при их наличии)? |
|  |
| Ответить "да" или "нет". Если "нет" – указать наименования (названия) и места нахождения таких организаций, обществ, филиалов, представительств, на которые действие данных политик и процедур не распространяется |
| 5. Определена ли в Организации ответственность за контроль рисков? |
|  |
| Ответить "да" или "нет" |
| 6. Имеет ли Организация четкую организационную структуру системы управления рисками (централизованная или децентрализованная в зависимости от объемов операций,  выделение функции внутреннего контроля рисков, участие операционных подразделений в оценке рисков, отделение ответственности за измерение, мониторинг и контроль рисков от ведения тех операций (основного бизнеса), в которых возникает  риск, независимая линия отчетности высшему менеджменту о состоянии рисков )? |
|  |
| Ответить "да" или "нет". Если "да" – указать, как построена структура |
| 7. Имеются ли у Организации системы распределения полномочий в управлении рисками, механизм принятия коллегиальных решений в случае пересечения зон ответственности или необходимости особого контроля над операциями? |
|  |
| Ответить "да" или "нет" |

|  |
| --- |
| 8. Проводится ли оценка эффективности внутренних политик и процедур Организации по управлению рисками ее подразделением внутреннего аудита и "внешней" аудиторской организацией? |
|  |
| Ответить "да" или "нет". Если "да" – указать дату и результаты последней внутренней и внешней аудиторской проверки |
| 9. Имеет ли Организация механизмы для обеспечения внутреннего бухгалтерского контроля и управления рисками? |
|  |
| Ответить "да" или "нет" |
| 10. Имеются ли у Организации процедуры по оценке рисков клиентов? |
|  |
| Ответить "да" или "нет" |
| 11. Соблюдает ли Организация лимиты рисков, устанавливаемые в отношении агрегированных рисков, отдельных видов рисков, отдельных структурных подразделений, отдельных лиц, совершающих сделки? |
|  |
| Ответить "да" или "нет" |
| 12. Применяет ли Организация методы снижения рисков (хеджирование, страхование, гарантирование, ограничение доступа, создание резервных мощностей)? |
|  |
| Ответить "да" или "нет". Если "да" – указать, какие именно |
| 13. Применяет ли Организация системы информации и отчетности о состоянии рисков, в том числе в сопоставлении с лимитами, непрерывный мониторинг и внутренний контроль рисков во всех аспектах и концентрациях, имеющих материальное значение для брокера–дилера? |
|  |
| Ответить "да" или "нет". Если "да" – указать, какие именно |
| 14. Соблюдает ли Организация порядок принятия решений по регулированию рисков, в том числе выдачи временных обязательных предписаний службой внутреннего контроля? |
|  |
| Ответить "да" или "нет" |
| 15. Применяет ли Организация непрерывную оценку эффективности системы управления рисками (верности принятых уровней рисков, адекватности лимитов, соответствия  методов измерения рисков, адекватности политик и процедур (с точки зрения изменения рыночных условий, персонала, технологии))? |
|  |
| Ответить "да" или "нет". Если "да" – указать, какую именно |
| 16. Проводит ли Организация проверку эффективности работы механизма контроля над рисками, единожды установленным руководством? |
|  |
| Ответить "да" или "нет" |

|  |
| --- |
| 17. Имеются ли у Организации планы чрезвычайных действий, в том числе на случаи пересечения различных видов рисков (порядок координации действий менеджмента, поддержание адекватной информации, четкое разделение обязанностей, обеспечение ведения операций в специальных случаях, механизмы восстановления и экстремальные источники поддержания операционной способности)? |
|  |
| Ответить "да" или "нет". Если "да" – указать, какие именно |
| 18. Применяет ли Организация методы оценки рисков, в том числе анализ  чувствительности к рискам, сценарный анализ, стресс- и бэк-тестирование (наихудшие сценарии, связанные с наступлениями риска)? |
|  |
| Ответить "да" или "нет". Если "да" – указать, какие именно |
| 19. Применяет ли Организация механизмы для проверки соблюдения контроля над рисками, после его установки? |
|  |
| Ответить "да" или "нет" |

**3**