

КАРТА

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"

Положение о клиринговых участниках

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"

Положение о клиринговых участниках

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"