

Тәуекелдердi басқару жүйесiнiң өзiн-өзi бағалау КАРТАСЫ

* Осы картада ұйым деп клирингiлiк қатысушыларға кандидат түсiнiледi

1. Заңды тұлғасы ұйым болып табылатын мемлекеттің уәкілетті органы IOSCO консультациялар, ынтымақтастық және ақпарат алмасу мәселелері бойынша өзара түсіністік туралы Меморандумға қол қойды?
"Иә" немесе "жоқ" деп жауап беріңіз
2. Ұйымның тәуекелдерді басқару жүйесі бар ма?
"Иә" немесе "жоқ" деп жауап беріңіз
3. Ұйымның тәуекелдердің жиынтық және жекелеген түрлерін басқару бойынша ішкі саясаты мен рәсімдері бар ма?
"Иә" немесе "жоқ" деп жауап беріңіз. Егер "иә" болса-саясат пен процедура деректерін тізімдеңіз
4. Тәуекелдерді басқару жөніндегі ұйымның ішкі саясаттары мен рәсімдерінің қолданылуы оның шетелдік еншілес ұйымдарына, тәуелді акционерлік қоғамдарға, филиалдарға, өкілдіктерге (олар болған кезде) қолданылады ма?
"Иә" немесе "жоқ" деп жауап беріңіз. Егер "жоқ" болса - осы саясаттар мен рәсімдердің қолданылуы қолданылмайтын осындай ұйымдардың, қоғамдардың, филиалдардың, өкілдіктердің атауларын (атауларын) және орналасқан жерлерін көрсету
5. Ұйымда тәуекелдерді бақылау жауапкершілігі анықталды ма?
"Иә" немесе "жоқ" деп жауап беріңіз.
6. Ұйымның тәуекелдерді басқару жүйесінің нақты ұйымдық құрылымы бар ма (операциялар көлеміне байланысты орталықтандырылған немесе орталықтандырылмаған, тәуекелдерді ішкі бақылау функциясын бөлу, тәуекелдерді бағалауға операциялық бөлімшелердің қатысуы, тәуекел туындайтын операцияларды (негізгі бизнесті) жүргізуден тәуекелдерді өлшеу, бақылау және бақылау жауапкершілігін бөлу, жоғары менеджментке тәуелсіз есеп беру желісі тәуекелдердің жай-күйі туралы)?
"Иә" немесе "жоқ" деп жауап беріңіз. Егер "иә" болса, құрылымның қалай салынғанын көрсетіңіз
7. Ұйымның тәуекелдерді басқаруда өкілеттіктерді бөлу жүйесі, жауапкершілік аймақтары қиылысқан немесе операцияларды ерекше бақылау қажет болған жағдайда алқалы шешімдер қабылдау тетігі бар ма?
"Иә" немесе "жоқ" деп жауап беріңіз.
8. Ішкі аудит бөлімшесі мен "сыртқы" аудиторлық ұйым тәуекелдерді басқару жөніндегі ұйымның ішкі саясаты мен рәсімдерінің тиімділігін бағалау жүргізіле ме?

Положение о клиринговых участниках

"Иә" немесе "жоқ" деп жауап беріңіз. Егер "иә" болса-соңғы ішкі және сыртқы аудиттің күні мен нәтижелерін көрсетіңіз
9. Ұйымның ішкі бухгалтерлік бақылау мен тәуекелдерді басқаруды қамтамасыз ету тетіктері бар ма?
"Иә" немесе "жоқ" деп жауап беріңіз
10. Ұйымда клиенттердің тәуекелдерін бағалау процедуралары бар ма?
"Иә" немесе "жоқ" деп жауап беріңіз
11. Ұйым жиынтық тәуекелдерге, тәуекелдердің жекелеген түрлеріне, жекелеген құрылымдық бөлімшелерге, мәмілелер жасайтын жекелеген тұлғаларға қатысты белгіленетін тәуекелдер лимиттерін сақтай ма?
"Иә" немесе "жоқ" деп жауап беріңіз
12. Ұйым тәуекелдерді азайту әдістерін қолдана ма (хеджирлеу, сақтандыру, кепілдік беру, қол жетімділікті шектеу, резервтік қуаттарды құру)?
"Иә" немесе "жоқ" деп жауап беріңіз. Егер "иә" болса, қайсысы екенін көрсету керек
13. Ұйым брокер–дилер үшін материалдық маңызы бар барлық аспектілер мен шоғырлануларда тәуекелдердің жай-күйі туралы ақпарат пен есептілік жүйесін, оның ішінде лимиттермен салыстыруда тәуекелдердің үздіксіз мониторингі мен ішкі бақылауын қолдана ма?
"Иә" немесе "жоқ" деп жауап беріңіз. Егер "иә" болса, қайсысы екенін көрсету керек
14. Ұйым тәуекелдерді реттеу бойынша шешімдер қабылдау, оның ішінде ішкі бақылау қызметінің уақытша міндетті нұсқамалар беру тәртібін сақтай ма?
"Иә" немесе "жоқ" деп жауап беріңіз
15. Ұйым тәуекелдерді басқару жүйесінің тиімділігін үздіксіз бағалауды қолдана ма (қабылданған тәуекел деңгейлерінің дұрыстығы, лимиттердің сәйкестігі, тәуекелдерді өлшеу әдістерінің сәйкестігі, саясат пен процедуралардың сәйкестігі (нарықтық жағдайлардың, персоналдың, технологияның өзгеруі тұрғысынан))?
"Иә" немесе "жоқ" деп жауап беріңіз. Егер "иә" болса, қайсысы екенін көрсету керек
16. Ұйым бір рет басшылық белгілеген тәуекелдерді бақылау тетігі жұмысының тиімділігіне тексеру жүргізе ме?
"Иә" немесе "жоқ" деп жауап беріңіз
17. Ұйымда Төтенше іс-әрекеттер, оның ішінде тәуекелдердің әртүрлі түрлерінің қиылысу жағдайларына арналған жоспарлар бар ма (менеджменттің іс-әрекеттерін үйлестіру тәртібі, барабар ақпаратты қолдау, міндеттерді нақты бөлу, арнайы жағдайларда операцияларды жүргізуді қамтамасыз ету, қалпына келтіру тетіктері және операциялық қабілетті қолдаудың экстремалды көздері)?
"Иә" немесе "жоқ" деп жауап беріңіз. Егер "иә" болса, қайсысы екенін көрсету керек

Положение о клиринговых участниках

18. Ұйым тәуекелді бағалау әдістерін, соның ішінде тәуекелге сезімталдықты талдауды, сценарийді талдауды, стрессті және бэк - тестілеуді (тәуекелдің басталуымен байланысты ең нашар сценарийлерді) қолдана ма?

"Иә" немесе "жоқ" деп жауап беріңіз. Егер "иә" болса, қайсысы екенін көрсету керек

19. Ұйым оны орнатқаннан кейін тәуекелдерді бақылаудың сақталуын тексеру тетіктерін қолдана ма?

"Иә" немесе "жоқ" деп жауап беріңіз