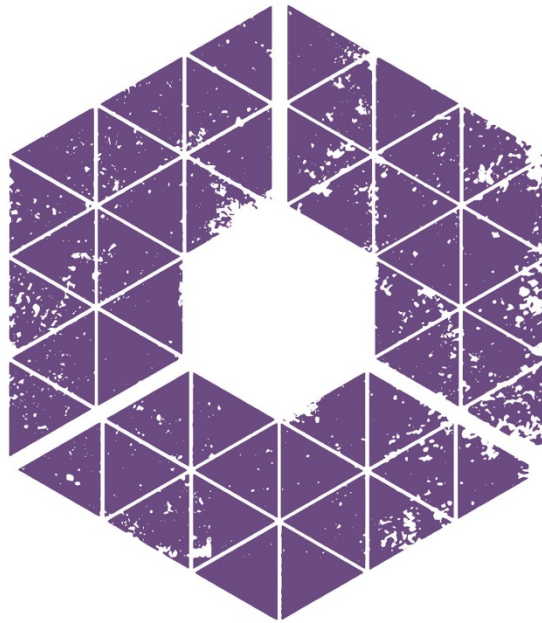


ПАРТАД



Внутренний стандарт управления рисками и внутреннего контроля участника финансового рынка – члена СРО ПАРТАД



2018

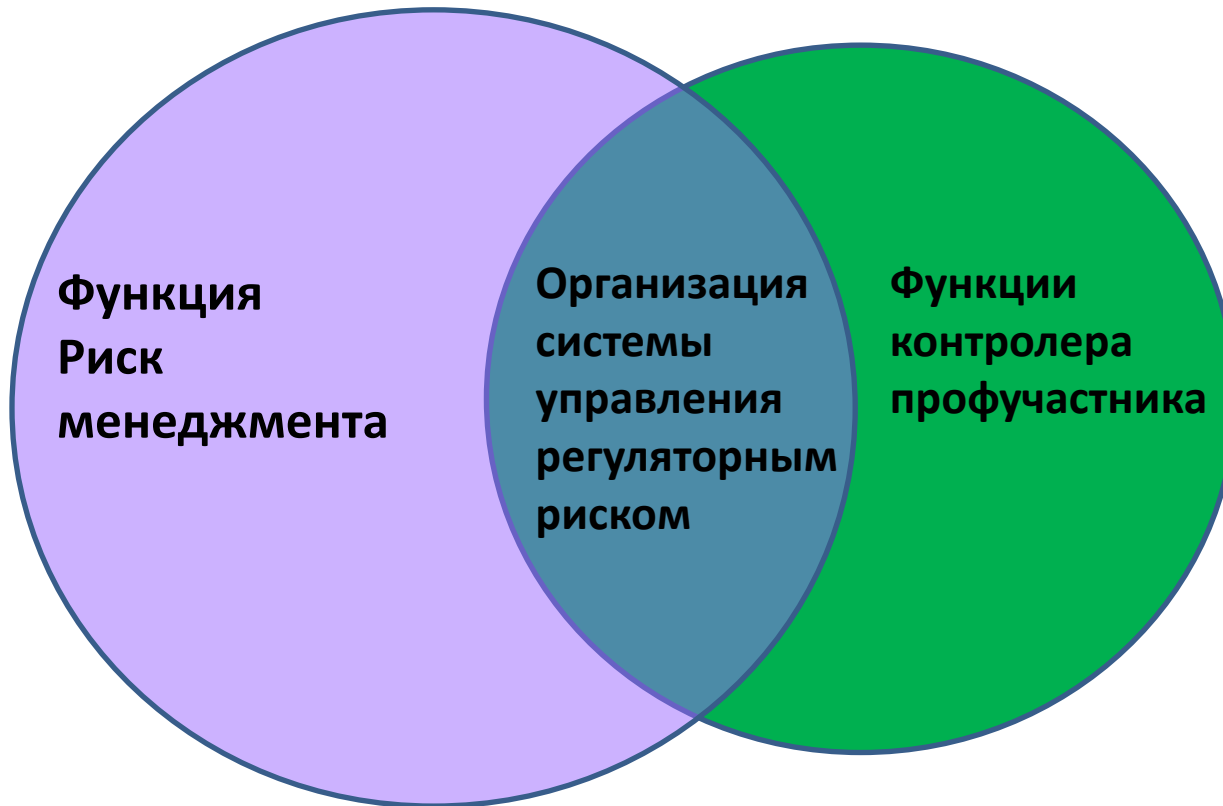
Регламентация построения СУР

- **Федеральный закон №39-ФЗ** от 22.04.1996 «О рынке ценных бумаг» (п. 5 ст. 10.1-1)
- **Указание Банка России №4501-У** от 21.08.2017 «О требованиях к организации ПУ РЦБ системы управления рисками, связанными с осуществлением профессиональной деятельности на РЦБ и с осуществлением операций с собственным имуществом, в зависимости от вида деятельности и характера совершаемых операций»
- **Внутренние стандарты СРО**
- **Стандарты международных организаций** (Стандарты COSO, ISO, документы Базельского комитета)
- **Национальные стандарты** (ГОСТ Р ИСО 31000:2010 «Менеджмент риска. Принципы и руководство», ГОСТ Р ИСО/МЭК 31010-2011 «Менеджмент риска. Методы оценки риска.» и пр.)

Содержание Внутреннего стандарта управления рисками и внутреннего контроля

- **Общие требования** к системам управления рисками и внутреннего контроля;
- **Цели** управления рисками и внутреннего контроля;
- **Принципы** управления рисками и внутреннего контроля;
- **Организационная характеристика** систем управления рисками и внутреннего контроля;
- **Оценка эффективности** функционирования систем управления рисками и внутреннего контроля
- **Документирование** систем управления рисками и внутреннего контроля;
- **Обмен информацией и отчетность**, формируемая в рамках систем управления рисками и внутреннего контроля;
- **Термины и определения** и др.

Риск-менеджмент



Оценка эффективности СУР

Эффективность может определяться в результате оценки наличия и эффективного функционирования компонентов:

- внутренняя среда,
- постановка целей,
- определение событий,
- оценка рисков,
- реагирование на риск,
- средства контроля,
- информация и коммуникация,
- мониторинг.

Для каждого компонента СУР определяются соответствующие ему **принципы**. **Оценка уровня реализации каждого принципа** управления рисками осуществляется по формуле:

*Уровень реализации принципа = Уровень значимости * Коэффициент реализации*

Покомпонентная сумма показателей реализации принципов позволяет оценить эффективность управления рисками организации.