

▶ Управление рисками

Ключевые риски

В Группе выстроена интегрированная система управления рисками, при этом каждой из компаний Группы присущи специфические виды рисков, обусловленные особенностями их деятельности. Так, ПАО Московская Биржа, являясь головной компанией Группы, несет риски организатора торгов.

Вместе с тем основным риск-тейкером Группы является НКО НКЦ (АО), выполняющее функции клиринговой организации, центрального контрагента на всех основных рынках Группы и оператора товарных поставок на товарном рынке.

Система управления рисками реализации действующей стратегии

Принципы и подходы к построению и функционированию системы управления рисками (СУР) Группы основаны на лучших мировых практиках с учетом требований национальных и международных стандартов в области управления рисками и капиталом. Группа проводит ежегодную проверку соответствия своей деятельности Принципам для инфраструктур финансового рынка CPMI-IOSCO, концепции (COSO) «Управление рисками организаций», рекомендациям Базельского комитета по банковскому надзору в области процедур управления рисками и капиталом кредитных организаций. Основной риск-тейкер Группы – НКО НКЦ (АО) – в 2017 году подтвердил сертификацию на соответствие международному стандарту Системы менеджмента качества ISO 9001:2015 (DNV Business Assurance Management System Certificate ISO 9001:2015), обобщающему передовой мировой опыт в области управления производством и менеджмента качества компании. Аудит был проведен Международным сертификационным обществом DNV-GL. Особенностью стандартов DNV-GL является предъявление требований к системе организации управления бизнес-процессами, которые призваны обеспечивать предсказуемый и стабильный уровень качества продукции и услуг.

Интеграция функций управления рисками в бизнес-процессы позволяет своевременно выявлять риски, оценивать их существенность, эффективно реагировать на них, добиваясь минимизации негативного воздействия и (или) снижения вероятности их реализации. Для минимизации рисков используются такие инструменты, как страхование, хеджирование, установление лимитов, установление требований к обеспечению сделок.

Единая система управления рисками в Группе охватывает также НКО АО НРД как инфраструктурный институт финансового рынка Российской Федерации, ориентированный на обеспечение надежной работы и стабильное развитие следующих ключевых направлений деятельности:

- ▶ Центральный депозитарий;
- ▶ Расчетно-платежная система;
- ▶ Торговый репозитарий;
- ▶ Предоставление трехсторонних сервисов;
- ▶ Центр корпоративной информации.