

Содержание

Предисловие

1. Введение

Вставка 1. КПРС — Технический комитет МОКЦБ. Рекомендации для
центральных контрагентов (ЦКА)

2. Область применения рекомендаций

3. Обзор рисков ЦКА и управления рисками

4. Рекомендации

Рекомендация 1. Правовой риск

Рекомендация 2. Требования, предъявляемые к участию в деятельности
ЦКА

Рекомендация 3. Оценка кредитных рисков и управление ими

Рекомендация 4. Требования по размещению обеспечения

Рекомендация 5. Финансовые ресурсы

Рекомендация 6. Процедуры установления неплатежеспособности

Рекомендация 7. Кастодиальный риск и риск инвестирования

Рекомендация 8. Операционный риск

Рекомендация 9. Расчеты по денежным средствам

Рекомендация 10. Физическая поставка

Рекомендация 11. Риски связей между ЦКА

Рекомендация 12. Эффективность

Рекомендация 13. Организация и структура управления

Рекомендация 14. Прозрачность

Рекомендация 15. Регулирование и наблюдение

5. Контрольный список вопросов для гарантийных фондов

Приложение 1. Типовая форма оценки соблюдения ЦКА настоящих
рекомендаций

Приложение 2. Типовая форма предоставления информации на основе
ответов на ключевые вопросы

Приложение 3. Глоссарий

Приложение 4. Члены Рабочей группы КИРС — МОКЦБ по системам
расчета по ценным бумагам