

Nowy kształt Komisji ds. Ryzyka w IRGiT

Łukasz Goliszewski - Dyrektor Działu Zarządzania Ryzykiem, IRGiT

Komisja ds. Ryzyka w CCP

- ◆ W świetle przepisów Rozporządzenia EMIR, Komisja ds. Ryzyka w izbie rozliczeniowej posiadającej status CCP pełni istotną rolę w obszarze zarządzania ryzykiem
- ◆ Komisja pełni funkcje opiniodawcze i doradcze wobec IRGiT w sprawach dotyczących Regulacji wewnętrznych lub uzgodnień, które:
 - ✓ mają wpływ na zarządzanie ryzykiem związanym ze świadczeniem przez IRGiT usług rozliczeniowych,
 - ✓ dotyczą bezpieczeństwa i efektywności prowadzenia rozliczeń na rynku towarowym i finansowym, prawidłowego ustalania rodzaju i wielkości zabezpieczeń oraz formy ich wnoszenia,
 - ✓ dotyczą mechanizmów zarządzania ryzykiem związanym ze świadczeniem przez IRGiT usług rozliczeniowych oraz mechanizmów kontroli ryzyka, za wyjątkiem spraw związanych z kierowaniem przez IRGiT bieżącą działalnością.

Skład Komisji ds. Ryzyka

- ◆ W skład Komisji ds. Ryzyka wchodzi:
 - ✓ wszyscy niezależni członkowie Rady,
 - ✓ co najmniej dwaj przedstawiciele Uczestników rozliczających IRGiT,
 - ✓ co najmniej dwaj przedstawiciele Klientów Uczestników rozliczających IRGiT.

- ◆ W szczególności w skład Komisji wejść mogą reprezentanci stowarzyszeń lub organizacji zrzeszających Uczestników rozliczających transakcje oraz ich klientów będących członkami izb rozliczeniowych prowadzonych przez IRGiT.

- ◆ Łączny skład komisji musi jednocześnie zapewniać, iż żadna z grup przedstawicieli nie ma większości w Komisji ds. Ryzyka.

Skład Komisji ds. Ryzyka

- ◆ Członkowie Komisji, będący przedstawicielami Uczestników i Klientów, są powoływani w skład Komisji przez Radę IRGiT na posiedzeniu Rady.
- ◆ Członkowie Komisji są wybierani spośród kandydatów wskazanych na wniosek Rady przez Uczestników oraz ich Klientów na piśmie wraz z opisem ich wykształcenia, kwalifikacji, doświadczenia i specjalistycznej wiedzy oraz, wyrażoną przez nich pisemną zgodą na kandydowanie na członka Komisji
- ◆ Powołanie członka Komisji ds. Ryzyka nie może rodzić konfliktu interesów dla osoby powołanej.
- ◆ Skład Komisji ds. Ryzyka publikowany będzie na stronie internetowej Izby

Regulamin Komisji ds. Ryzyka

- ◆ Zasady funkcjonowania Komisji ds. Ryzyka określa Regulamin Komisji ds. Ryzyka, który udostępniony będzie na stronie internetowej Izby, po uzyskaniu akceptacji Komisji Nadzoru Finansowego

Kwestie podlegające opinii Komisji

- ◆ zarządzanie przez IRGiT ryzykami powstającymi w związku z prowadzeniem działalności w ramach organizowanych systemów rozliczeń, w tym dokonywanie wszechstronnych przeglądów modeli, metodologii oraz zasad przyjętych dla kwantyfikowania, grupowania i zarządzania tymi ryzykami oraz zasad zarządzania ryzykiem związanym z płynnością,
- ◆ sprawy dotyczące regulaminów określających zasady i tryb rozliczania transakcji zawieranych w obrocie instrumentami finansowymi, regulaminu funduszu rozliczeniowego, regulaminów funduszy zabezpieczających oraz uchwał wydanych na podstawie tych regulaminów,
- ◆ kategorie podmiotów, które mogą ubiegać się o status Uczestnika rozliczającego oraz warunki uczestnictwa, które mają spełniać te podmioty,
- ◆ klasy instrumentów pochodnych, które mogą być przyjmowane do systemów rozliczeń organizowanych przez IRGiT,

Kwestie podlegające opinii Komisji

- ◆ przekazanie do innego podmiotu czynności z zakresu prowadzenia rozliczeń lub systemu zabezpieczania płynności rozliczania transakcji albo innych czynności oraz projekty umów outsourcingowych, które mogą znacząco wpłynąć na zarządzanie ryzykiem,
- ◆ procedury postępowania w razie wystąpienia przypadku niewykonania zobowiązania lub niewypłacalności Uczestnika rozliczającego albo konieczności wykorzystania środków systemu zabezpieczania płynności rozliczania transakcji,
- ◆ rozszerzenie zakresu zezwolenia posiadanego przez IRGiT na świadczenie nowych usług,
- ◆ zawarcie uzgodnienia interoperacyjnego,

Kwestie podlegające opinii Komisji

- ◆ środki zaradcze zmierzające do usunięcia zaistniałego Konfliktu Interesów,
- ◆ Regulacje wewnętrzne określające rodzaje skrajnych warunków rynkowych,
- ◆ zbiór historycznych i hipotetycznych scenariuszy wykorzystywanych do identyfikowania skrajnych warunków rynkowych,
- ◆ Regulacje wewnętrzne określające zasady zarządzania ryzykiem utraty płynności, w tym plan zachowania płynności,
- ◆ wyniki testów warunków skrajnych i ich analizę,
- ◆ Regulacje wewnętrzne określające stosowanie kontraktów pochodnych,

Opinia Komisji

Opinia Komisji odnośnie przedłożonej mu do rozpatrzenia sprawy powinna zawierać w szczególności:

- ◆ a) wskazanie ryzyk związanych z daną czynnością, w tym ocenę wpływu danej czynności na istniejące ryzyka, którymi zarządza IRGiT,
- ◆ b) ocenę możliwości efektywnego zarządzania przez IRGiT tymi ryzykami, ze wskazaniem postulowanych sposobów zarządzania tymi ryzykami,
- ◆ c) zalecenie odnośnie decyzji, którą powinno podjąć IRGiT w przedmiocie danej kwestii wraz z uzasadnieniem.

Dziękuję za uwagę!

Łukasz Goliński, Dyrektor Działu Zarządzania Ryzykiem, IRGiT
lukasz.golinski@irgit.pl

Izba Rozliczeniowa Giełd Towarowych S.A.
Al. Jana Pawła II 80 lok. F 35
00-175 Warszawa

