AZƏRBAYCAN RESPUBLİKASI DÖVLƏT NEFT FONDUNUN

RİSKLƏRİN İDARƏ EDİLMƏSİ DEPARTAMENTİ HAQQINDA

Ə S A S N A M Ə

1. ÜMUMİ MÜDDƏALAR

1.1. Azərbaycan Respublikası Dövlət Neft Fondunun (bundan sonra – Fond) Risklərin İdarə Edilməsi Departamenti (bundan sonra – Departament) Fondun aparatının struktur bölməsidir.

1.2. Departament öz fəaliyyətində Azərbaycan Respublikasının Konstitusiyasını, Azərbaycan Respublikasının qanunlarını, Azərbaycan Respublikası Prezidentinin fərman və sərəncamlarını, "Azərbaycan Respublikasının Dövlət Neft Fondu haqqında Əsasnamə"ni, Fondun əmr və sərəncamlarını və bu Əsasnaməni rəhbər tutur.

1.3. Departament bu Əsasnamə ilə müəyyən olunmuş funksiyaların yerinə yetirilməsi prosesində Fondun digər struktur bölmələri ilə qarşılıqlı şəkildə fəaliyyət göstərir.

1.4. Əsasnamədə aşağıdakı əsas termin və anlayışlar istifadə olunmuşdur:

Bençmark – investisiya portfelinin hədəf gəlirliliyi və müqayisəsi üçün istifadə olunan standart;
Ənənəvi maliyyə alətləri – sabit gəlirli qiymətli kağızlar və səhmlər;
Alternativ maliyyə alətləri – daşınmaz əmlak, özəl səhmlər və s.

2. DEPARTAMENTİN FƏALİYYƏTİNİN ƏSAS MƏQSƏDİ

Departamentin əsas məqsədi Fondun investisiya siyasətinin layihəsinin hazırlanması və investisiya siyasətinin tətbiqi çərçivəsində risklərin idarə edilməsindən ibarətdir.

3. DEPARTAMENTİN FUNKSİYALARI

Departamentin funksiyaları aşağıdakılardan ibarətdir:

3.1. Fondun investisiya siyasətində məhdudiyyətlərin, o cümlədən risk limitlərinin müəyyən edilməsi ilə bağlı təkliflərin verilməsi;

3.2. İnvestisiya portfeli üzrə risklərin idarə edilməsi və gəlirliliyinin ölçülməsi;
3.3. Investisiya fəaliyyətinin müvafiq qanunlar, normativ hüquqi aktlar və standartlar ilə uyğunluğuna nəzarətin təmin edilməsi (bundan sonra – Komplayns).

4. DEPARTAMENTİN VƏZİFƏLƏRİ

Departament bu Əsasnamə ilə müəyyən olunmuş funksiyaları həyata keçirmək üçün aşağıdakı vəzifələri yerinə yetirir:

4.1. İnvestisiya siyasətinin hazırlanması və Bençmarkların seçilməsi ilə bağlı müvafiq təhlillərin aparılması, risk limitlərinin müəyyən olunması və təkliflərin hazırlanması;
4.2. Fondun investisiya portfelinə daxil olan Ənənəvi maliyyə alətlərinə dair Fondun investisiya strategiyasının yenilənməsi və nəzarət altında saxlanılması prosesində iştirak edilməsi;
4.3. Fondun investisiya siyasətinin tətbiqi çərçivəsində Ənənəvi maliyyə alətləri üzrə risklərin müəyyən edilməsi, qiymətləndirilməsi, tənzimlənməsi, nəzarət altında saxlanılması və müvafiq məlumat bazasının yaradılması;
4.4. İnvestisiya portfelinin gəlirliliyinin, Bençmarka nəzərən kənarlaşmanın və gəlirlilik üzrə bölgünün hesablanması;
4.5. İnvestisiya siyasətinə uyğun olaraq investisiya portfelinin maliyyə alətləri və valyutalar üzrə bölgüsünün nəzarət altında saxlanılması;
4.6. Müxtəlif göstəricilər üzrə ssenarilərin Fondun investisiya portfelinə təsirini müəyyən etmək məqsədilə stress testlərin və ssenari təhlillərinin həyata keçirilməsi;
4.7. Fondun investisiya portfelinə daxil olan Alternativ maliyyə alətləri üzrə Fondun investisiya strategiyasının yenilənməsi və nəzarət altında saxlanılması prosesində iştirak edilməsi;
4.8. Fondun investisiya siyasətinin tətbiqi çərçivəsində Alternativ maliyyə alətləri üzrə risklərin müəyyən edilməsi, qiymətləndirilməsi, tənzimlənməsi, nəzarət altında saxlanılması və müvafiq məlumat bazasının yaradılması;
4.9. Fondun investisiya fəaliyyəti ilə əlaqədar Komplaynsın səmərəli icrasını təmin etmək məqsədilə müvafiq daxili normativ sənədlərin yaradılması, mütəmadi olaraq təkmilləşdirilməsi və Fond daxilində tətbiqinin təşkil edilməsi;

4.10. Fondun investisiya fəaliyyətinin “Valyuta vəsaitlərinin saxlanılması, yerləşdirilməsi və idarə edilməsi haqqında Qaydalar”, illik əsasda təsdiq olunan “İnvestisiya Siyasəti”, Fondun İcraçı direktoru tərəfindən təsdiq edilən aidiyyatı daxili normativ sənədlərə, habelə investisiya portfelinin xarici menecerlərə idarəedilməyə verilmiş hissəsi ilə bağlı xarici menecerlərin fəaliyyətinin müvafiq investisiya mandatları ilə uyğunluğuna nəzarətin həyata keçirilməsi;

4.11. Fondun investisiya fəaliyyəti ilə bağlı beynəlxalq maliyyə tənzimləmələri üzrə dəyişikliklərdən irəli gələn risklərin müəyyən edilməsi, qiymətləndirilməsi, tənzimlənməsi və nəzarət altında saxlanılması;

4.12. Fondun investisiya fəaliyyəti ilə əlaqədar tərəf müqabillərinin sorğular və araşdırmalar vasitəsilə təhlili, onlar tərəfindən ünvanlanan sorğuların cavablandırılması;

4.13. Departamentin fəaliyyət istiqamətləri çərçivəsində dövri olaraq hesabatların hazırlanması və aidiyyatı üzrə təqdim edilməsi;

4.14. Fondun rəhbərliyinin göstərişlərinə əsasən risklərin idarə edilməsinə dair digər vəzifələrin yerinə yetirilməsi.

5. DEPARTAMENTİN FƏALİYYƏTİNİN TƏŞKİLİ

5.1. Departamentin təşkilati strukturu və işçilərinin sayı Fondun İcraçı direktoru tərəfindən müəyyən və təsdiq edilir.

5.2. Departamentin fəaliyyətinə Departamentin direktoru rəhbərlik edir. Departamentin direktoru Fondun İcraçı direktoru tərəfindən vəzifəyə təyin edilir və vəzifədən azad edilir. Departamentin direktoru Departamentə həvalə olunmuş vəzifələrin yerinə yetirilməsi üçün şəxsən məsuliyyət daşıyır.

5.3. Departamentin direktoru:

5.3.1. Departamentin fəaliyyətini təşkil edir və ona rəhbərlik edir;

5.3.2. Tabeliyində olan işçilər arasında iş bölgüsü aparır, onların fəaliyyətini əlaqələndirir, əmək və icra intizamına riayət edilməsinə nəzarət edir;

5.3.3. Departamentin fəaliyyətinə dair mühüm məsələlər barədə məlumatı Fondun rəhbərliyinə təqdim edir;

5.3.4. Departamentin işçiləri barəsində həvəsləndirmə və intizam tənbehi tədbirləri görülməsi üçün Fondun rəhbərliyinə təqdimatlar verir;

5.3.5. Daxil olan məktub, ərizə, şikayət və təkliflərə qanunvericilikdə nəzərdə tutulmuş qaydada baxılmasını təşkil edir;

5.3.6. Departamentdə kargüzarlıq işlərinin aparılmasını təmin edir;

5.3.7. Departamenti təmsil edir;

5.3.8. Departamentin direktoru olmadığı halda onun vəzifələrinin yerinə yetirilməsi Departamentin direktorunun müavininə həvalə olunur.

5.4. Departamentin tərkibinə Modelləşdirmə və gəlirliliyin ölçülməsi və Alternativ investisiyalar üzrə risklərin idarə edilməsi şöbələri (bundan sonra Şöbə) daxildir. Şöbənin fəaliyyətinə Şöbənin müdiri rəhbərlik edir. Şöbə müdiri Fondun İcraçı direktoru tərəfindən vəzifəyə təyin edilir və vəzifədən azad edilir. Şöbə müdiri Şöbəyə həvalə olunmuş vəzifələrin yerinə yetirilməsinə görə şəxsən məsuliyyət daşıyır. Şöbə müdiri olmadığı halda onun vəzifələrinin yerinə yetirilməsi departamentin işçilərindən birinə həvalə olunur.

5.5. Şöbənin vəzifələri departamentin vəzifələri bölməsində qeyd olunmuşdur və 4.1 – 4.14 bəndlərini əhatə edir:

Modelləşdirmə və gəlirliliyin ölçülməsi şöbəsi- 4.1. – 4.6., 4.13. və 4.14.

Alternativ investisiyalar üzrə risklərin idarə edilməsi şöbəsi- 4.7. – 4.14.

5.6 Şöbə müdiri:

5.6.1 Şöbənin fəaliyyətini təşkil edir və ona rəhbərlik edir;

5.6.2 Tabeliyində olan işçilər arasında iş bölgüsü aparır, onların fəaliyyətini əlaqələndirir, əmək, icra və xidmət intizamına riayət edilməsinə nəzarət edir;

5.6.3 Şöbənin fəaliyyətinə dair mühüm məsələlər barədə məlumatı Departamentin direktoruna təqdim edir;

5.6.4 Şöbənin işçiləri barəsində həvəsləndirmə və intizam tənbehi tədbirləri görülməsi üçün Departamentin direktoruna təkliflər verir;

5.6.5 Şöbədə kargüzarlıq işlərinin aparılmasını təmin edir;

5.6.6 Şöbəni təmsil edir.