

Центральный Банк
Российской Федерации (Банк России)

ЗАРЕГИСТРИРОВАНО

Дата 26 декабря 2018



УТВЕРЖДЕНО
решением Совета директоров
Акционерного общества
«Санкт - Петербургская Валютная Биржа»
26 ноября 2018 г. (Протокол №311)

Управляющий
Акционерного общества
«Санкт - Петербургская Валютная Биржа»


/С.Б.Еганов/

**ПРАВИЛА ОРГАНИЗАЦИИ СИСТЕМЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ,
СВЯЗАННЫМИ С ОСУЩЕСТВЛЕНИЕМ
ДЕЯТЕЛЬНОСТИ ОРГАНИЗАТОРА ТОРГОВЛИ
И КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ
АКЦИОНЕРНЫМ ОБЩЕСТВОМ
«САНКТ-ПЕТЕРБУРГСКАЯ ВАЛЮТНАЯ БИРЖА»**

Новая редакция

г. Санкт-Петербург
2018 г.

1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

- 1.1. Акционерное общество «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» (далее – СПВБ, организатор торговли, клиринговая организация) совмещает деятельность по организации торговли и клиринговую деятельность.
- 1.2. В рамках осуществления клиринговой деятельности СПВБ не осуществляет функции центрального контрагента.
- 1.3. Правила организации системы управления рисками, связанными с осуществлением деятельности организатора торговли и клиринговой деятельности Акционерным обществом «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» (далее – Правила управления рисками), разработаны в соответствии с требованиями:
 - Федерального закона от 21.11.2011 №325-ФЗ (ред. 04.06.2018) «Об организованных торгах»;
 - Федерального закона от 07.02.2011 №7-ФЗ (ред. 29.07.2018) «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте»;
 - принятых в соответствии с ними нормативных актов Банка России;
 - Приказа ФСФР России от 25.06.2013 №13-53/пз-н «Об утверждении требований к деятельности организатора торговли в части организации системы управления рисками и порядка осуществления внутреннего контроля, а также к отдельным внутренним документам организатора торговли» (далее – Приказ №13-53/пз-н);
 - Положения о требованиях, направленных на снижение рисков осуществления клиринговой деятельности, и требования к документу (документам), определяющему (определяющим) меры, направленные на снижение кредитных, операционных и иных рисков, в том числе рисков, связанных с совмещением клиринговой деятельности с иными видами деятельности, утвержденного Банком России 12.03.2015 №463-П и зарегистрированного в Минюсте России 30.04.2015 №37079 (ред. от 15.03.2018) (далее – Положение №463-П);
 - Устава Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» (с изменениями, утвержденными решением годового общего собрания акционеров Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» 16 июня 2016 года, протокол № 37) и внутренних нормативных документов СПВБ.
- 1.4. Правила управления рисками определяют принципы, элементы системы, методы управления рисками, порядок мониторинга и контроля за эффективностью системы управления рисками, органы, ответственные за ее функционирование, и раскрытие информации о ней.
- 1.5. Правила управления рисками утверждаются Советом директоров СПВБ и подлежат регистрации в Банке России.

2. ОСНОВНЫЕ ОПРЕДЕЛЕНИЯ

- 2.1. Основные термины, используемые в Правилах управления рисками:
 - 2.1.1. *Риск* – влияние неопределенности на цели организации.
 - 2.1.2. *Существенный риск* – риск, реализация которого может существенным образом затруднить или сделать невозможной дальнейшую деятельность СПВБ (аннулирование лицензии, приостановление операций).
 - 2.1.3. *Управление рисками (риск-менеджмент)* – скоординированные действия по управлению организацией с учетом риска.
 - 2.1.4. *Система управления рисками (система риск-менеджмента)* – набор компонентов, обеспечивающих основы и организационную структуру для разработки, внедрения, мониторинга, пересмотра и постоянного улучшения риск-менеджмента в масштабе всей организации.
 - 2.1.5. *Риск-менеджер* – должностное лицо, ответственное за организацию системы управления рисками СПВБ (за исключением регуляторного риска клиринговой организации).
 - 2.1.6. *Регулятор* – Банк России, осуществляющий принятие нормативных актов, контроль и надзор в сфере финансовых рынков.
 - 2.1.7. *Реестр рисков* – список выявленных (идентифицированных) рисков СПВБ.

- 2.1.8. *План управления рисками* – внутренний документ СПВБ, описывающий меры по управлению рисками СПВБ.
- 2.1.9. *Аудитор СПВБ* – аудиторская организация, осуществляющая аудит бухгалтерской (финансовой) отчетности СПВБ. Аудитор СПВБ назначается решением общего собрания акционеров СПВБ, которое принимается по рекомендации Совета директоров СПВБ, формируемой Комитетом Совета директоров СПВБ по рискам и аудиту (Комитетом по рискам) в соответствии с Положением о Комитете Совета директоров АО СПВБ по рискам и аудиту.
- 2.1.10. *Служба внутреннего аудита* – структурное подразделение СПВБ, сформированное для осуществления внутреннего аудита в СПВБ.
- 2.1.11. *Ревизионная комиссия* – орган контроля СПВБ, избираемый общим собранием акционеров СПВБ и осуществляющий контроль над финансово-хозяйственной деятельностью СПВБ.
- 2.1.12. *Правила клиринга* – Правила клиринга Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

3. ПОЛИТИКА УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

- 3.1. Политика СПВБ в области управления рисками (принципы, цели, задачи и организационная структура) является разделом Правил управления рисками и определяется Советом директоров СПВБ путем утверждения Правил управления рисками.
- 3.2. СПВБ рассматривает управление рисками как один из важнейших элементов стратегического управления и внутреннего контроля. В процессе управления рисками СПВБ регулярно выявляет, оценивает и контролирует угрозы и возможности, адаптирует свою деятельность с целью уменьшения вероятности и потенциальных последствий угроз и с целью реализации возможностей, а также информирует об этом акционеров и иных заинтересованных лиц.
- 3.3. В рамках своей политики управления рисками СПВБ учитывает как интересы акционеров, так и возможные последствия своей деятельности для других заинтересованных сторон.
- 3.4. Система управления рисками СПВБ направлена на повышение вероятности достижения стратегических целей и снижение вероятности и размера возможных потерь. Для этого СПВБ устанавливает уровни приемлемого риска для каждой категории существенных рисков.
- 3.5. В системе управления рисками СПВБ используется организационная модель самостоятельного управления рисками. Организационная структура системы управления рисками СПВБ включает в себя:
 - Совет директоров СПВБ (Совет директоров);
 - Комитет Совета директоров СПВБ по рискам и аудиту;
 - Управляющего СПВБ;
 - Правление СПВБ;
 - Риск-менеджера;
 - Руководителей структурных подразделений;
 - Контролера;
 - Службу внутреннего аудита;
 - Руководителей структурных подразделений, отвечающих за непосредственное управление рисками и реализацию мероприятий в соответствии с Планом управления рисками.
- 3.6. Политика СПВБ в области управления рисками определяется характером и масштабом операций и исходит из принципа разумной достаточности.
- 3.7. Система управления рисками СПВБ призвана:
 - 3.7.1. обеспечить выполнение требований регулятора к деятельности СПВБ в части организации системы управления рисками;
 - 3.7.2. обеспечить выполнение требований надлежащей практики корпоративного управления, в соответствии с которыми СПВБ должна обращать особое внимание на учет, мониторинг рисков, управление ими и должное раскрытие информации в этой области;

- 3.7.3. предупреждать ситуации, угрожающие стратегическим целям СПВБ, и обеспечивать соответствующую защиту;
 - 3.7.4. обеспечить координацию и интеграцию процессов управления рисками, относящихся к различным аспектам финансово-хозяйственной деятельности, в целях общего повышения эффективности управления СПВБ;
 - 3.7.5. обеспечить использование новых возможностей для увеличения стоимости активов и прибыльности СПВБ в долгосрочной перспективе.
- 3.8. В целях эффективного контроля со стороны Совета директоров СПВБ за системой управления рисками создан Комитет Совета директоров СПВБ по рискам и аудиту, действующий на постоянной основе.
- 3.9. К задачам Комитета по рискам относятся:
- 3.9.1. оценка эффективности и совершенствование системы управления рисками СПВБ, связанной с организацией торгов, а также с осуществлением операций с собственным имуществом;
 - 3.9.2. оценка эффективности и совершенствование системы управления рисками СПВБ как клиринговой организации;
 - 3.9.3. оценка возможного влияния планов развития деятельности СПВБ на существующие риски и на возникновение новых рисков;
 - 3.9.4. оценка кандидатов в аудиторы и представление результатов такой оценки Совету директоров СПВБ;
 - 3.9.5. рассмотрение заключения Аудитора СПВБ до его представления общему собранию акционеров СПВБ;
 - 3.9.6. взаимодействие с Ревизионной комиссией и Аудитором СПВБ;
 - 3.9.7. оценка эффективности действующих на СПВБ процедур внутреннего контроля и подготовка предложений по их совершенствованию;
 - 3.9.8. предварительное одобрение документов, определяющих правила организации системы управления кредитными, операционными и иными рисками, в том числе рисками, связанными с совмещением клиринговой деятельности с иными видами деятельности, меры по обеспечению бесперебойного функционирования программно-технических средств, предназначенных для осуществления клиринговой деятельности, меры, направленные на предотвращение и урегулирование конфликта интересов при осуществлении клиринга и совмещении клиринговой деятельности с иными видами деятельности;
 - 3.9.9. предварительное одобрение документа, определяющего меры, принимаемые СПВБ в случаях возникновения чрезвычайных обстоятельств, которые могут препятствовать нормальному осуществлению клиринговой деятельности, и направленные на обеспечение непрерывности осуществления такой деятельности.
- 3.10. Статус и компетенция Комитета по рискам, права и обязанности Комитета по рискам и его членов, состав Комитета по рискам, порядок его формирования, работы и взаимодействия с иными органами управления СПВБ определены в документе «Положение о Комитете Совета директоров АО СПВБ по рискам и аудиту».
- 3.11. Все предложения, разработанные Комитетом по рискам, носят рекомендательный характер.
- 3.12. По результатам ежегодной оценки системы управления рисками Совет директоров СПВБ формулирует свое мнение по следующим вопросам:
- 3.12.1. изменение характера и относительной значимости существенных рисков, произошедшие со времени последней ежегодной проверки, а также способность СПВБ реагировать на такие изменения;
 - 3.12.2. качество и объем работы в сфере управления рисками, выполняемой исполнительными органами, подразделением внутреннего аудита и другими органами внутреннего контроля СПВБ;
 - 3.12.3. своевременность и полнота отчетности по состоянию системы управления рисками, предоставляемой Правлением СПВБ Совету директоров или его комитетам;

- 3.12.4. существенные ошибки системы управления рисками за отчетный период, а также последствия (в том числе ожидаемые в будущем) таких ошибок для финансово-хозяйственной деятельности СПВБ;
- 3.12.5. эффективность предоставления СПВБ отчетности внешним заинтересованным лицам.
- 3.13. Реализация политики управления рисками в рамках СПВБ осуществляется Управляющим СПВБ.
- 3.14. Управляющий СПВБ назначает должностное лицо, ответственное за организацию системы управления рисками СПВБ за исключением регуляторного риска клиринговой организации (риск-менеджера), при условии, что для риск-менеджера СПВБ является основным местом работы.
- 3.15. Риск-менеджер не может осуществлять функции, которые не связаны с управлением или организацией системы управления рисками и осуществлением СПВБ внутреннего контроля, за исключением случаев, установленных Приказом №13-53/пз-н и Положением №463-П, и при исполнении своих обязанностей не должен зависеть от других должностных лиц и структурных подразделений СПВБ.
- 3.16. На риск-менеджера не могут быть возложены обязанности, исполнение которых может привести к возникновению конфликта интересов.
- 3.17. Риск-менеджер подотчетен Совету директоров.
- 3.18. Функции риск-менеджера:
 - 3.18.1. подготовка проектов документов СПВБ по управлению рисками;
 - 3.18.2. координация взаимодействия структурных подразделений СПВБ в процессе управления рисками;
 - 3.18.3. контроль деятельности структурных подразделений СПВБ в процессе управления рисками;
 - 3.18.4. подготовка отчетов для Совета директоров, Правления СПВБ и Управляющего СПВБ;
 - 3.18.5. поддержание эффективного обмена информацией, необходимой для оперативного и стратегического управления рисками, между Управляющим СПВБ, Правлением СПВБ и структурными подразделениями СПВБ;
 - 3.18.6. ведение информационной базы, содержащей сведения о фактах нарушения нормальной работы;
 - 3.18.7. контроль и мониторинг системы управления рисками.
- 3.19. Риск-менеджер вправе требовать у сотрудников и должностных лиц СПВБ предоставления информации (документов), в том числе письменных объяснений, по вопросам, связанным с управлением рисками и возникающим в ходе выполнения им своих обязанностей.
- 3.20. Сотрудники СПВБ обязаны незамедлительно доводить до сведения своего непосредственного руководителя, риск-менеджера и Контролера информацию о возможных и совершенных нарушениях Федеральных законов «Об организованных торгах» и «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» и принятых в соответствии с ними нормативных актов Банка России, Устава и внутренних документов СПВБ, связанных с деятельностью по организации торговли и клиринговой деятельностью.
- 3.21. Управляющий СПВБ утверждает план управления рисками, устанавливающий должностных лиц и структурные подразделения СПВБ, ответственные за реализацию мероприятий по управлению рисками СПВБ.
- 3.22. Служба внутреннего аудита осуществляет проверку эффективности методологии оценки рисков и процедур управления рисками, связанных с деятельностью по организации торговли и клиринговой деятельностью, установленных внутренними документами СПВБ, и полноты применения указанных документов, в том числе проверка деятельности риск-менеджера.
- 3.23. Служба внутреннего аудита предоставляет отчеты о проведении аудита Совету директоров и Управляющему СПВБ.

4. ВЫЯВЛЕНИЕ, ИДЕНТИФИКАЦИЯ, ОЦЕНКА И КОНТРОЛЬ РИСКОВ

- 4.1. СПВБ осуществляет на постоянной основе выявление областей возникновения, идентификацию, оценку и контроль всех существенных рисков, связанных с деятельностью СПВБ как организатора торговли и клиринговой организации.
- 4.2. СПВБ ведет реестр рисков, в котором описывается содержание каждого риска, приводится экспертная оценка данного риска, вероятности его возникновения и возможного убытка для деятельности СПВБ.
- 4.3. Выявление рисков, а также их первичный анализ, оценка и квалификация осуществляются должностными лицами и структурными подразделениями СПВБ, ответственными за управление отдельными видами рисков.
- 4.4. При выявлении нового риска в реестр рисков вносятся изменения, в том числе отражающие изменения внешних и внутренних условий деятельности СПВБ.
- 4.5. По каждому из существенных рисков оценивается вероятность тех или иных возможных последствий и их ожидаемое воздействие на стоимость бизнеса для акционеров.
- 4.6. Для оценки каждого существенного риска используется простой, поддающийся измерению и однозначному толкованию показатель (индикатор риска). Для каждого индикатора риска определяются критические значения, исходя из уровня приемлемого риска и соответствующих целей СПВБ.
- 4.7. После первичной оценки выявленных рисков Правление СПВБ пересматривает выявленные риски в свете приоритетных задач и нужд СПВБ. В результате риски могут переоцениваться.
- 4.8. Реестр рисков пересматривается и изменяется по необходимости, но не реже одного раза в год. Реестр рисков рассматривается Правлением и утверждается Управляющим СПВБ и служит основой для разработки плана управления рисками.
- 4.9. СПВБ проводит обучение (консультации) сотрудников СПВБ по вопросам выявления, идентификации и оценки рисков, а также контроля над ними.

5. ВИДЫ РИСКОВ И МЕТОДЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

- 5.1. СПВБ как организатор торговли осуществляет управление следующими видами рисков:
 - 5.1.1. операционный риск;
 - 5.1.2. регуляторный риск;
 - 5.1.3. риск потери деловой репутации;
 - 5.1.4. правовой риск;
 - 5.1.5. стратегический риск.
- 5.2. СПВБ как клиринговая организация осуществляет управление следующими видами рисков:
 - 5.2.1. операционный риск;
 - 5.2.2. кредитный риск;
 - 5.2.3. системный риск;
 - 5.2.4. рыночный риск;
 - 5.2.5. риск ликвидности;
 - 5.2.6. кастодиальный риск;
 - 5.2.7. риск потери деловой репутации;
 - 5.2.8. правовой риск;
 - 5.2.9. коммерческий риск;
 - 5.2.10. регуляторный риск.
- 5.3. Полный список выявленных рисков, содержится в реестре рисков СПВБ.
- 5.4. Порядок реагирования и принятия управленческих решений СПВБ в случае приближения показателей риска СПВБ к критическим значениям устанавливается внутренним документом «Регламент реагирования в случае приближения показателей риска ЗАО СПВБ к критическим значениям».
- 5.5. В каждом случае применяется метод, позволяющий достичь разумного соотношения ожидаемого экономического эффекта и затрат, связанных с использованием такого метода.
- 5.6. К основным методам управления рисками, применяемым в СПВБ, относятся:
 - 5.6.1. принятие и учет риска;

- 5.6.2. разделение риска с другими сторонами;
 - 5.6.3. отказ от риска;
 - 5.6.4. финансирование риска (страхование, направление дополнительных ресурсов на проект, понижение уровня риска до приемлемого);
 - 5.6.5. диверсификация рисков.
- 5.7. С целью реализации мер по управлению выявленными рисками СПВБ разрабатывает план управления рисками, который содержит наименование выявленных рисков, мероприятия по управлению этими рисками, критерии успешности управления рисками, ответственных сотрудников (подразделения) СПВБ и сроки проведения мероприятий.
- 5.8. План управления рисками вместе с реестром рисков рассматриваются Правлением СПВБ и утверждаются Управляющим СПВБ.
- 5.9. План управления рисками пересматривается по мере необходимости, но не реже одного раза в год вместе с реестром рисков.

6. УПРАВЛЕНИЕ ОПЕРАЦИОННЫМ РИСКОМ

- 6.1. *Операционный риск* – риск возникновения расходов (убытков) СПВБ в связи с осуществлением ей деятельности, предусмотренной Федеральным законом «Об организованных торгах» и Федеральным законом «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте», в результате нарушения нормальной работы структурных подразделений СПВБ, штатной работы программно-технических средств СПВБ, правил и требований к совершению СПВБ операций, в том числе по причине ошибок, недобросовестных или умышленных действий сотрудников СПВБ, технических сбоев, а также влияния внешних обстоятельств.
- 6.2. Организация управлением операционным риском осуществляется риск-менеджером, а непосредственное управление – структурными подразделениями СПВБ, участвующими в организации торгов и клиринговой деятельности. Структурные подразделения СПВБ, ответственные за управление операционным риском, определяются в плане управления рисками.
- 6.3. Порядок и способы выявления, оценки, мониторинга, контроля и (или) минимизации операционного риска:
- 6.3.1. структурные подразделения СПВБ, ответственные за управление операционным риском, осуществляют выявление областей возникновения и идентификацию новых операционных рисков;
 - 6.3.2. в случае выявления нового риска руководитель соответствующего структурного подразделения составляет отчет о выявленном операционном риске и передает его риск-менеджеру;
 - 6.3.3. риск-менеджер организует оценку выявленного риска и при необходимости инициирует внесение изменений в реестр рисков и план управления рисками;
 - 6.3.4. в случае нарушения нормальной работы структурных подразделений, штатной работы программно-технических средств, правил и требований к осуществлению деятельности по организации торговли, которые могли привести (привели) к расходам (убыткам) СПВБ, а также оценку таких расходов (убытков), руководитель соответствующего структурного подразделения составляет отчет о нарушении нормальной работы и передает его риск-менеджеру;
 - 6.3.5. риск-менеджер проводит анализ нарушения нормальной работы и адекватности мер, предусмотренных планом управления рисками. При необходимости он инициирует внесение изменений в реестр рисков и план управления рисками;
 - 6.3.6. риск-менеджер осуществляет ведение информационной базы, содержащей сведения о фактах нарушения нормальной работы;
 - 6.3.7. риск-менеджер предоставляет отчет о нарушении нормальной работы Правлению СПВБ и Управляющему СПВБ не позднее 10 (десяти) дней с даты выявления соответствующего нарушения;

- 6.3.8. взаимодействие между подразделениями СПВБ в случае возникновения нештатных ситуаций определено в документе «Порядок взаимодействия между подразделениями Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» при возникновении нештатных ситуаций».
- 6.4. Порядок осуществления тестирования программно-технических средств, используемых для осуществления деятельности по организации торговли и клиринговой деятельности:
- 6.4.1. СПВБ осуществляет тестирование программно-технических средств, используемых для осуществления деятельности по организации торговли и клиринговой деятельности, с периодичностью не реже одного раза в 6 месяцев. Должностные лица (структурные подразделения) СПВБ, ответственные за осуществление тестирования, устанавливаются в плане управления рисками.
- 6.4.2. Испытательные работы (тестирование) средств проведения торгов осуществляются путем имитации технических условий, в которых проводятся реальные организованные торги, а при необходимости – путем проведения пробной эксплуатации.
- 6.4.3. Сценарии, используемые при проведении тестирования, должны предусматривать экстремальное превышение нормальных (среднестатистических) рабочих нагрузок на программно-технические средства, используемые для осуществления деятельности по организации торговли и клиринговой деятельности.
- 6.4.4. Общие требования к сценариям и порядку проведения тестирования программно-технических средств, используемых для осуществления деятельности по организации торговли и клиринговой деятельности, определяются внутренним документом СПВБ «Методика тестирования программно-технических средств, используемых АО СПВБ для осуществления деятельности по организации торговли и клиринговой деятельности», который утверждается приказом Управляющего СПВБ.
- 6.4.5. Конкретные сценарии и порядок проведения тестирования программно-технических средств, используемых для осуществления деятельности по организации торговли и клиринговой деятельности, определяются внутренним документом СПВБ «План тестирования программно-технических средств, используемых АО СПВБ для осуществления деятельности по организации торговли и клиринговой деятельности», который утверждается приказом Управляющего СПВБ перед проведением каждого тестирования.
- 6.4.6. Результаты тестирования программно-технических средств, используемых для осуществления деятельности по организации торговли и клиринговой деятельности, оформляются протоколом.
- 6.4.7. Протокол с результатами тестирования программно-технических средств доводится до сведения Правления СПВБ и Управляющего СПВБ в течение одного рабочего дня после проведения тестирования.
- 6.5. СПВБ использует основной и резервный комплекс средств проведения клиринга, расположенные на территории Российской Федерации и снабженные альтернативными источниками электропитания.
- 6.6. СПВБ осуществляет контроль (аудит) основных процессов создания и эксплуатации автоматизированных систем, входящих в состав средств проведения клиринга, включая контроль обеспечения информационной безопасности, на соответствие требованиям документов, разрабатываемых в рамках законодательства Российской Федерации о техническом регулировании с учетом положений международных стандартов, не реже одного раза в два года с привлечением независимых консультантов и предоставлением результатов такого контроля (аудита) в Банк России не позднее трех рабочих дней с даты получения заключения консультантов (аудиторов).
- 6.7. Меры, направленные на недопущение потерь, искажения или/и утечки данных, а также по обеспечению бесперебойного функционирования программно-технических средств, предназначенных для осуществления деятельности по организации торговли и клиринговой деятельности, определяются документом «Порядок хранения и защиты информации Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

- 6.8. Меры, принимаемые СПВБ в чрезвычайных ситуациях и направленные на обеспечение непрерывности осуществления деятельности СПВБ, определены в документе «План обеспечения непрерывности и восстановления деятельности Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

7. УПРАВЛЕНИЕ РЕГУЛЯТОРНЫМ РИСКОМ

- 7.1. *Регуляторный риск* – риск возникновения расходов (убытков) СПВБ в результате несоответствия СПВБ или ее деятельности требованиям Федерального закона «Об организованных торгах», Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» и принятых в соответствии с ними нормативных актов Банка России, а также документов СПВБ, связанных с деятельностью организатора торговли и клиринговой деятельностью и зарегистрированных в Банке России.
- 7.2. Управление регуляторным риском СПВБ при осуществлении деятельности организатора торговли осуществляется риск-менеджером.
- 7.3. Управление регуляторным риском СПВБ при осуществлении клиринговой деятельности осуществляется Контролером на основании Правил внутреннего контроля СПВБ.
- 7.4. При управлении регуляторным риском организатора торговли СПВБ риск-менеджер осуществляет следующие процессы и действия:
- 7.4.1. осуществляет оценку регуляторного риска организатора торговли СПВБ с учетом вероятности его наступления и влияния на деятельность по проведению организованных торгов;
 - 7.4.2. дает рекомендации органам управления, должностным лицам, в том числе руководителям структурных подразделений СПВБ, о мерах, которые необходимо предпринять для устранения регуляторного риска организатора торговли СПВБ;
 - 7.4.3. осуществляет контроль выполнения мер, направленных на устранение регуляторного риска организатора торговли СПВБ;
 - 7.4.4. предоставляет информацию о регуляторном риске организатора торговли СПВБ Правлению СПВБ и Управляющему СПВБ;
 - 7.4.5. обеспечивает доведение до сотрудников СПВБ информации, необходимой для снижения регуляторного риска организатора торговли СПВБ, в том числе проводит обучение и консультации по вопросам, связанным с регулированием деятельности СПВБ нормативными актами Банка России и внутренними документами СПВБ;
 - 7.4.6. участвует в разработке документов, которые регламентируют осуществление деятельности СПВБ по организации торговли;
 - 7.4.7. участвует в рассмотрении жалоб и запросов участников торгов СПВБ и заявлений третьих лиц, связанных с осуществлением деятельности по организации торговли;
 - 7.4.8. принимает меры, направленные на обеспечение конфиденциальности информации, полученной в процессе управления регуляторным риском организатора торговли СПВБ;
 - 7.4.9. предпринимает иные меры, направленные на управление регуляторным риском организатора торговли, предусмотренные внутренними документами СПВБ.
- 7.5. Информация о регуляторном риске организатора торговли СПВБ предоставляется риск-менеджером Правлению СПВБ и Управляющему СПВБ в форме ежеквартальных отчетов, а также в иных формах, предусмотренных внутренними документами СПВБ.

8. УПРАВЛЕНИЕ РИСКОМ ПОТЕРИ ДЕЛОВОЙ РЕПУТАЦИИ

- 8.1. *Риск потери деловой репутации* – риск возникновения расходов (убытков) СПВБ в результате уменьшения числа участников торгов или уменьшения объема торгов вследствие формирования в обществе негативного представления об операционной (технической) устойчивости СПВБ, качестве оказываемых ей услуг или характере деятельности в целом.
- 8.2. Управление риском потери деловой репутации осуществляется риск-менеджером.
- 8.3. В целях управления риском потери деловой репутации СПВБ разрабатываются системы информационного обеспечения, не позволяющие использовать информацию, имеющуюся у СПВБ,

- в ущерб деловой репутации СПВБ, а также обеспечивающие своевременное предоставление органам управления СПВБ информации о негативных и позитивных отзывах о СПВБ, в том числе содержащихся в сообщениях и материалах, распространенных средствами массовой информации, размещенных в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» и иных источниках.
- 8.4. Функции риск-менеджера при управлении риском потери деловой репутации:
- 8.4.1. мониторинг и анализ публикаций о СПВБ, распространяемых средствами массовой информации, а также в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»;
 - 8.4.2. подготовка отчетов о фактах публикации негативных и позитивных отзывов о СПВБ для органов управления СПВБ;
 - 8.4.3. подготовка комментариев и опровержений недостоверной/порочащей информации о СПВБ.
- 8.5. В случае публикации в средствах массовой информации, размещения в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» и иных источниках недостоверной/порочащей СПВБ информации предусмотрен следующий порядок действий:
- 1) В случае выявления недостоверной/порочащей СПВБ информации риск-менеджер ставит в известность о данном факте Правление СПВБ и Управляющего СПВБ.
 - 2) Управляющий принимает решение о необходимости извещения о данном факте:
 - Совета директоров СПВБ;
 - акционеров СПВБ, владеющих более 5% уставного капитала СПВБ;
 - крупнейших клиентов СПВБ.
 - 3) Правление СПВБ и Управляющий СПВБ (при необходимости совместно с Советом директоров СПВБ) вырабатывают план действий.
 - 4) СПВБ излагает свою точку зрения в отношении опубликованной информации. Для подтверждения своей позиции СПВБ предоставляет всем заинтересованным сторонам финансовую отчетность и иные необходимые документы.
- 8.6. В случае необходимости СПВБ готовит для публикации в средствах массовой информации, размещения в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» и иных источниках (в том числе на официальном сайте СПВБ) опровержение недостоверной/порочащей информации.

9. УПРАВЛЕНИЕ СТРАТЕГИЧЕСКИМ РИСКОМ

- 9.1. *Стратегический риск* – риск возникновения расходов (убытков) СПВБ в результате ошибок (недостатков), допущенных при принятии решений, определяющих стратегию деятельности и развития СПВБ.
- 9.2. Стратегия деятельности и развития СПВБ определяется Советом директоров СПВБ. Управление стратегическим риском осуществляется Советом директоров СПВБ и риск-менеджером.
- 9.3. В целях управления стратегическим риском СПВБ при осуществлении долгосрочного планирования развития деятельности СПВБ органы управления СПВБ обязаны принимать во внимание эффективность системы управления рисками СПВБ.
- 9.4. При разработке планов по увеличению баланса и прибыли, усложнению операционной структуры, расширению бизнеса, введению новых продуктов и направлений деятельности СПВБ осуществляется обязательная оценка возможного влияния реализации этих планов на существующие риски и на возникновение новых рисков.
- 9.5. Экспертизу возможного влияния реализации этих планов на существующие риски и на возникновение новых рисков осуществляет Комитет по рискам, который дает свои рекомендации Совету директоров СПВБ.

10. КРЕДИТНЫЙ РИСК

- 10.1. *Кредитный риск* – риск возникновения расходов (убытков) СПВБ в результате нежелания или неспособности контрагентов по договорам исполнить свои обязательства перед СПВБ.
- 10.2. При осуществлении СПВБ деятельности организатора торговли и клиринговой деятельности кредитных рисков СПВБ не возникает, так как СПВБ не выполняет функций центрального

контрагента и не принимает на себя обязательств, связанных с исполнением сделок, заключенных на СПВБ.

- 10.3. Кредитный риск СПВБ может возникнуть при размещении временно свободных средств СПВБ в банковские депозиты и другие финансовые инструменты.
- 10.4. Требования к инвестиционной деятельности СПВБ определяются Положением об инвестиционных критериях размещения временно свободных средств биржи, которое утверждается Советом директоров СПВБ.
- 10.5. Внутренние процедуры принятия решений СПВБ при размещении временно свободных средств в депозиты в коммерческих банках определяются Порядком размещения временно свободных средств биржи в депозиты в коммерческих банках.
- 10.6. Совет директоров СПВБ устанавливает лимиты на банки с учетом рекомендаций Комитета по рискам.

11. СИСТЕМНЫЙ РИСК

- 11.1. *Системный риск* – риск возникновения расходов (убытков) клиринговой организации, при котором неспособность выполнить свои обязательства одного или нескольких участников финансового рынка вызывает неспособность выполнить свои обязательства надлежащим образом других участников финансового рынка.
- 11.2. Системный риск в деятельности СПВБ как клиринговой организации отсутствует, так как в соответствии с Правилами клиринга у СПВБ не возникают расходы (убытки) в случае возникновения ситуации, когда неспособность выполнить свои обязательства одного или нескольких участников финансового рынка вызывает неспособность выполнить свои обязательства надлежащим образом других участников финансового рынка.

12. РЫНОЧНЫЙ РИСК

- 12.1. *Рыночный риск* – риск возникновения расходов (убытков) клиринговой организации вследствие неблагоприятного изменения рыночной стоимости финансовых инструментов или иных активов, в которые инвестированы средства клиринговой организации или средства, предоставленные ей в качестве обеспечения исполнения обязательств.
- 12.2. Рыночный риск, связанный с неблагоприятным изменением рыночной стоимости финансовых инструментов или иных активов, предоставленных СПВБ участниками клиринга в качестве обеспечения исполнения обязательств отсутствует, так как СПВБ не выполняет функций центрального контрагента и в соответствии с Правилами клиринга не несет ответственности за исполнение обязательств перед участниками клиринга.
- 12.3. Рыночный риск, связанный с неблагоприятным изменением рыночной стоимости финансовых инструментов или иных активов, в которые инвестированы собственные средства СПВБ, управляется путем установления системы соответствующих лимитов на каждый вид актива и способа контроля над соблюдением принятой системы лимитов.
- 12.4. Состав и структура активов, в которые могут быть инвестированы собственные средства СПВБ, определяются Положением об инвестиционных критериях размещения временно свободных средств биржи, которое утверждается Советом директоров СПВБ.

13. ПРАВОВОЙ РИСК

- 13.1. *Правовой риск* – риск возникновения расходов (убытков) СПВБ как организатора торговли и/или клиринговой организации вследствие неоднозначности толкования норм права.
- 13.2. В целях снижения правового риска Контролер СПВБ при необходимости проводит консультации с Регулятором по неоднозначно толкуемым нормам права, связанными с оказанием услуг в области организации торговли и клиринговой деятельности.
- 13.3. Юридическая служба СПВБ осуществляет постоянный мониторинг судебной практики, связанной с оказанием услуг в области организации торговли и клиринговой деятельности и осуществляет анализ возможных правовых рисков.

14. РИСК ЛИКВИДНОСТИ

- 14.1. *Риск ликвидности* – риск возникновения расходов (убытков) клиринговой организации вследствие недостаточности имущества в распоряжении клиринговой организации для удовлетворения требований ее кредиторов по передаче этого имущества в установленный срок.
- 14.2. Управление риском ликвидности СПВБ осуществляется на основании внутреннего документа «Порядок управления риском ликвидности АО СПВБ».
- 14.3. Порядок действий СПВБ в случае недостаточности имущества, находящегося в ее распоряжении для удовлетворения требований кредиторов по передаче этого имущества, определяется в документе «Порядок управления риском ликвидности АО СПВБ».

15. КАСТОДИАЛЬНЫЙ РИСК

- 15.1. *Кастодиальный риск* – риск утраты имущества клиринговой организации или имущества, переданного ей в качестве обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу, вследствие действий или бездействия лица, ответственного за хранение этого имущества и учет прав на это имущество.
- 15.2. В соответствии с Правилами клиринга СПВБ принимает в качестве обеспечения исполнения обязательств, допущенных к клирингу, только денежные средства в рублях или в иностранной валюте.
- 15.3. Денежные средства в рублях участников клиринга хранятся исключительно на торговых и клиринговых счетах, открытых в Небанковской кредитной организации акционерном обществе «Петербургский Расчетный Центр» и Небанковской кредитной организации акционерном обществе «Национальный расчетный депозитарий», которые учитывают все средства на корреспондентских счетах в Банке России.
- 15.4. Денежные средства участников клиринга в иностранной валюте хранятся в банках, имеющих долгосрочный кредитный рейтинг агентства Standard & Poor's выше ВВ.

16. КОММЕРЧЕСКИЙ РИСК

- 16.1. *Коммерческий риск* – риск превышения расходов клиринговой организации над ее доходами, не связанный с реализацией кредитного и (или) кастодиального риска.
- 16.2. В целях управления коммерческим риском СПВБ создан Бюджетный комитет Совета директоров СПВБ (далее – Бюджетный комитет).
- 16.3. Основной целью создания Бюджетного комитета является повышение эффективности работы Совета директоров в области финансового планирования посредством предварительного рассмотрения вопросов, относящихся к его компетенции, и подготовки соответствующих рекомендаций Совету директоров СПВБ.
- 16.4. В компетенцию Бюджетного комитета входят следующие основные вопросы:
- 16.4.1. подготовка рекомендаций по формированию бюджетной политики СПВБ;
 - 16.4.2. подготовка рекомендаций по формированию годовых смет СПВБ в разрезе кварталов:
 - сметы доходов и расходов;
 - сметы расходов фонда потребления;
 - сметы капитальных вложений и прочее.
 - 16.4.3. подготовка ежеквартальных и годовых отчетов о выполнении смет, утвержденных Советом директоров СПВБ;
 - 16.4.4. предварительное рассмотрение инвестиционных программ СПВБ, включая сметную стоимость и бизнес-план инвестиционного проекта;
 - 16.4.5. предварительное рассмотрение отчетов о ходе выполнения утвержденных Советом директоров СПВБ инвестиционных программ;
 - 16.4.6. анализ бюджетного процесса и выработка рекомендаций по его совершенствованию.
- 16.5. Деятельность Бюджетного комитета регулируется Положением о Бюджетном комитете Совета директоров СПВБ, утвержденном Советом директоров СПВБ.

17. УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ, СВЯЗАННЫМИ С СОВМЕЩЕНИЕМ КЛИРИНГОВОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ И ДЕЯТЕЛЬНОСТИ ПО ОРГАНИЗАЦИИ ТОРГОВЛИ

- 17.1. СПВБ совмещает клиринговую деятельность и деятельность по организации торговли.
- 17.2. В связи с совмещением СПВБ клиринговой деятельности с деятельностью по организации торговли на СПВБ созданы отдельные структурные подразделения для осуществления разных видов деятельности:
- 17.2.1. для осуществления клиринговой деятельности создан клиринговый отдел СПВБ, к исключительным функциям которого относится осуществление клиринговой деятельности;
 - 17.2.2. для осуществления деятельности по организации торговли на рынке ценных бумаг создан фондовый отдел СПВБ;
 - 17.2.3. для осуществления деятельности по организации торговли на валютном и межбанковском кредитном рынке создан отдел валютного и межбанковского кредитного рынка СПВБ.
- 17.3. Для осуществления внутреннего контроля за соответствием деятельности СПВБ, осуществляющей деятельность по организации торговли, требованиям законодательства Российской Федерации, нормативных актов Банка России, иных нормативных правовых актов Российской Федерации, правил и иных внутренних документов СПВБ, а также для управления регуляторным риском клиринговой деятельности СПВБ назначен Контролер. Для разграничения прав доступа при вводе и обработке данных реализовано организационно-техническое разделение доступа сотрудников структурных подразделений СПВБ к информационным ресурсам СПВБ с учетом функций, определенных положениями о соответствующих структурных подразделениях и должностными инструкциями сотрудников СПВБ.
- 17.4. Меры, направленные на предотвращение и урегулирование конфликта интересов при осуществлении клиринга и совмещении клиринговой деятельности с деятельностью по организации торговли, определены документом «Перечень мер, направленных на предотвращение и урегулирование конфликта интересов при проведении организованных торгов и осуществлении клиринговой деятельности».

18. СИСТЕМА КОНТРОЛЯ И ОТЧЕТНОСТИ

- 18.1. СПВБ осуществляет мониторинг и непрерывный контроль за управлением рисками организатора торговли и клиринговой организации и соответствием предпринимаемых мер воздействия на риски характеру и масштабу операций.
- 18.2. Мониторинг и контроль системы управления рисками включает:
- 18.2.1. сбор информации о всех текущих нарушениях нормальной работы;
 - 18.2.2. выявление остающихся рисков;
 - 18.2.3. контроль выполнения плана управления рисками;
 - 18.2.4. оценку эффективности действий по минимизации рисков;
 - 18.2.5. подготовку отчетов, связанных с управлением рисками.
- 18.3. Система внутренней отчетности СПВБ включает в себя следующие отчеты:
- 18.3.1. ежедневный отчет о рисках клиринговой организации (ежедневный отчет об исполнении обязательств участниками клиринга);
 - 18.3.2. ежемесячный отчет о рисках (за исключением регуляторного риска клиринговой организации);
 - 18.3.3. ежеквартальный отчет о рисках (за исключением регуляторного риска клиринговой организации);
 - 18.3.4. отчет о выявленном операционном риске;
 - 18.3.5. отчет о нарушении нормальной работы;
 - 18.3.6. ежеквартальный отчет о регуляторном риске организатора торговли;
 - 18.3.7. отчетность Контролера, связанная с управлением регуляторным риском клиринговой организации, установлена Правилами внутреннего контроля СПВБ при осуществлении клиринговой деятельности.

- 18.4. Ежедневный отчет о рисках клиринговой организации предоставляется риск-менеджеру, и содержит информацию о нарушениях и задержках в исполнении обязательств участниками клиринга.
- 18.5. Ежемесячный отчет о рисках содержит сводную информацию о рисках организатора торговли и клиринговой организации и предоставляется Правлению СПВБ и Управляющему СПВБ не позднее 5 (пяти) дней с даты окончания очередного месяца.
- 18.6. Ежемесячный отчет о рисках (за исключением регуляторного риска клиринговой организации) включает:
- 1) оценку рисков (за исключением регуляторного риска клиринговой организации) по основным направлениям деятельности СПВБ, ее обоснование, включая сведения о нарушениях СПВБ требований Федеральных законов «Об организованных торгах» и «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» и принятых в соответствии с ними нормативных актов Банка России, устава и внутренних документов СПВБ, связанных с деятельностью по организации торговли и клиринговой деятельностью;
 - 2) меры, принятые СПВБ для устранения выявленных нарушений и снижения рисков (за исключением регуляторного риска клиринговой организации);
 - 3) сведения о выполнении рекомендаций риск-менеджера;
 - 4) иные сведения, предусмотренные внутренними документами СПВБ.
- 18.7. По результатам рассмотрения ежемесячного отчета и иной информации, предоставляемой риск-менеджером, органы управления и/или должностные лица СПВБ принимают решения, необходимые для снижения рисков, а также устранения последствий их реализации.
- 18.8. Ежеквартальный отчет о рисках (за исключением регуляторного риска клиринговой организации) формируется на основании ежемесячных отчетов о рисках (за исключением регуляторного риска клиринговой организации) и предоставляется Комитету по рискам, Правлению СПВБ и Управляющему СПВБ не позднее 30 (тридцати) дней с даты окончания очередного квартала.
- 18.9. Комитет по рискам рассматривает ежеквартальный отчет о рисках (за исключением регуляторного риска клиринговой организации) и, при необходимости, вырабатывает рекомендации для Совета директоров по совершенствованию системы управления рисками и предоставляет их Совету директоров в порядке и в сроки, определенные Положением о Комитете Совета директоров АО СПВБ по рискам и аудиту.
- 18.10. Совет директоров СПВБ рассматривает ежеквартальный отчет о рисках (за исключением регуляторного риска клиринговой организации) на ближайшем после составления и представления Управляющему СПВБ отчета заседании Совета директоров СПВБ.
- 18.11. В случае нарушения нормальной работы СПВБ в результате реализации какого-либо риска риск-менеджер предоставляет отчет о нарушении нормальной работы Правлению СПВБ и Управляющему СПВБ не позднее 10 (десяти) дней с даты выявления соответствующего нарушения.
- 18.12. Проверки эффективности системы управления рисками СПВБ осуществляется риск-менеджером не реже одного раза в 3 месяца. Проверка включает в себя сбор и анализ информации, предоставляемой риск-менеджеру структурными подразделениями и должностными лицами СПВБ, а также отчетов о выявленном риске и отчетов о нарушении нормальной работы за период. Результаты проверки включаются в ежеквартальный отчет о рисках (за исключением регуляторного риска клиринговой организации).
- 18.13. Оценка эффективности системы управления рисками и совершенствование системы управления рисками СПВБ осуществляется Службой внутреннего аудита и Комитетом по рискам.

19. РАСКРЫТИЕ ИНФОРМАЦИИ ОБ УПРАВЛЕНИИ РИСКАМИ

- 19.1. СПВБ поддерживает эффективный обмен информацией, необходимой для оперативного и стратегического управления рисками, между Советом директоров СПВБ, Правлением СПВБ и всеми функциональными подразделениями СПВБ.
- 19.2. Порядок и сроки информирования органов управления СПВБ, его должностных лиц и структурных подразделений о рисках:

- 19.2.1. риск-менеджер, обязан доводить до сведения всех заинтересованных структурных подразделений СПВБ информацию обо всех изменениях в реестре рисков и плане управления рисками в течение одного рабочего дня после их утверждения;
- 19.2.2. руководители структурных подразделений СПВБ обязаны доводить до сведения сотрудников структурных подразделений СПВБ данную информацию в течение одного рабочего дня после ее получения;
- 19.2.3. риск-менеджер предоставляет ежемесячные отчеты о рисках Правлению СПВБ и Управляющему СПВБ не позднее 5 (пяти) дней с даты окончания очередного месяца;
- 19.2.4. риск-менеджер предоставляет ежеквартальные отчеты, включая результаты проверки эффективности системы управления рисками СПВБ, Комитету по рискам, Правлению СПВБ и Управляющему СПВБ не позднее 30 (тридцати) дней с даты окончания очередного квартала;
- 19.2.5. риск-менеджер предоставляет Совету директоров ежеквартальный отчет на ближайшем после составления и представления Управляющему СПВБ отчете заседании.
- 19.3. Для обеспечения конфиденциальности информации о рисках, в том числе конфиденциальности отчетов о рисках риск-менеджера, следующим документам присваивается гриф «Для служебного пользования» в соответствии с внутренним документом СПВБ «Перечень мер, направленных на предотвращение неправомерного использования служебной информации СПВБ», утверждаемым приказом Управляющего СПВБ:
- 19.3.1. реестр рисков СПВБ;
- 19.3.2. план управления рисками СПВБ;
- 19.3.3. ежедневный отчет о рисках клиринговой организации (ежедневный отчет об исполнении обязательств участниками клиринга);
- 19.3.4. ежемесячный отчет о рисках (за исключением регуляторного риска клиринговой организации);
- 19.3.5. ежеквартальный отчет о рисках (за исключением регуляторного риска клиринговой организации);
- 19.3.6. отчет о выявленном операционном риске;
- 19.3.7. отчет о нарушении нормальной работы;
- 19.3.8. ежеквартальный отчет о регуляторном риске организатора торговли.
- 19.4. Меры, направленные на недопущение несанкционированного доступа, потерь, искажения и/или утечки информации, определяются в документе «Порядок хранения и защиты информации Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».
- 19.5. Для внешних заинтересованных лиц СПВБ в своем годовом отчете раскрывает следующую информацию:
- информацию о существенных рисках, с которыми сталкивается СПВБ;
 - сведения о процедурах контроля за существенными рисками и методах управления ими;
 - сведения об изменениях, вносимых в систему управления рисками СПВБ, и причинах таковых.
- 19.6. Документы, регистрируемые в Банке России, подлежат раскрытию в течение пяти рабочих дней с даты получения СПВБ официального решения Банка России (или его копии) о регистрации документов, но не позднее, чем за три рабочих дня до даты вступления их в силу.
20. ПЕРЕЧЕНЬ ВНУТРЕННИХ ДОКУМЕНТОВ, ОТНОСЯЩИХСЯ К СИСТЕМЕ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ
- 20.1. К системе управления рисками СПВБ относятся также следующие внутренние документы, в том числе содержащие процедуры по идентификации, мониторингу и контролю за рисками организации:
- Положение о Комитете Совета директоров СПВБ по рискам и аудиту;
 - Положение о внутреннем аудите Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»;
 - Положение о Бюджетном комитете Совета директоров СПВБ;
 - Перечень мер, направленных на предотвращение и урегулирование конфликта интересов при проведении организованных торгов и осуществлении клиринговой деятельности;
 - План обеспечения непрерывности и восстановления деятельности Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» (План ОНВД);

- Методика тестирования Плана обеспечения непрерывности и восстановления деятельности Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»;
- Методика самооценки процесса обеспечения готовности к инцидентам и непрерывности деятельности Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»;
- Порядок взаимодействия между подразделениями Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» при возникновении нештатных ситуаций;
- Методика тестирования программно-технических средств, используемых АО СПВБ для осуществления деятельности по организации торговли и клиринговой деятельности;
- Порядок хранения и защиты информации Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»;
- Положение об инвестиционных критериях размещения временно свободных средств биржи;
- Порядок размещения временно свободных средств биржи в депозиты в коммерческих банках;
- Порядок управления риском ликвидности АО СПВБ;
- Перечень мер, направленных на предотвращение неправомерного использования служебной информации СПВБ;
- Внутренний регламент клиринговой организации Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».

21. ПЕРЕЧЕНЬ ЗНАЧИМЫХ КЛИРИНГОВЫХ УСЛУГ

- 21.1. Порядок оказания клиринговых услуг СПВБ описан в Правилах клиринга СПВБ.
- 21.2. СПВБ оказывает следующие клиринговые услуги:
- клиринговое обслуживание сделок, заключенных в Секции межбанковского кредитного рынка;
 - клиринговое обслуживание сделок, заключенных в Секции валютного рынка;
 - клиринговое обслуживание сделок, заключенных в фондовой секции.
- 21.3. К значимым клиринговым услугам, приостановление или прекращение оказания которых по оценке клиринговой организации может существенно повлиять на финансовое положение СПВБ и (или) финансовое положение участников клиринга относится:
- 21.3.1. клиринговое обслуживание сделок, заключенных в Секции межбанковского кредитного рынка.

22. ПЕРЕЧЕНЬ МЕР, ПОРЯДОК И СРОКИ ИХ ПРИНЯТИЯ В СЛУЧАЕ НАСТУПЛЕНИЯ ОБСТОЯТЕЛЬСТВ, КОТОРЫЕ МОГУТ ПРИВЕСТИ К ПРИОСТАНОВЛЕНИЮ ИЛИ ПРЕКРАЩЕНИЮ ОКАЗАНИЯ ЗНАЧИМЫХ УСЛУГ

- 22.1. К обстоятельствам, наступление которых может привести к приостановлению или прекращению оказания значимых услуг, относятся события, связанные с реализацией операционного и регуляторного риска. В случае несоблюдения требований, предъявляемых к участникам клиринга, или неисполнения участниками клиринга их обязанностей, установленных Правилами клиринга СПВБ, их клиринговое обслуживание может быть также приостановлено.
- 22.2. Перечень мер, порядок и сроки их принятия клиринговой организацией в случае наступления обстоятельств, которые могут привести к приостановлению или прекращению клирингового обслуживания, установлены Правилами клиринга СПВБ, Внутренним регламентом клиринговой организации Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» и Планом обеспечения непрерывности и восстановления деятельности Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа».
- 22.3. Применяются следующие количественные и качественные критерии непрерывности процессов и критические сроки восстановления процессов при проведении клиринга:
- СПВБ должна своевременно и в полном объеме, в соответствии с требованиями нормативных документов, обеспечить надежность и безопасность операций в клиринговой системе;
 - перерыв в клиринговых операциях до начала торгов не должен превышать 1 часа, в противном случае торговая сессия отменяется;

- перерыв в клиринговых операциях после завершения торгов не должен превышать 2 часов, в противном случае клиринговая сессия и расчеты переносятся на следующий день.
- 22.4. Порядок действий СПВБ в случае неудовлетворения нетто-требований должником, в том числе порядок покрытия возникающих в этой связи расходов (убытков), а также порядок действий СПВБ в случае недостаточности имущества, находящегося в ее распоряжении для удовлетворения требований кредиторов по передаче этого имущества, подробно описан в Правилах клиринга СПВБ в подразделе «Порядок прекращения обязательств в связи с введением процедур банкротства Участника клиринга и определения размера денежного обязательства, возникающего в связи с таким прекращением».
- 22.5. В случае наступления обстоятельств, не предусмотренных п.22.4 и повлекших убытки СПВБ, в результате которых СПВБ оказалась не в состоянии оказывать значимые клиринговые услуги, предпринимаются следующие действия:
- 22.5.1. Клиринговый отдел незамедлительно информирует торговые отделы о прекращении клиринга сделок и не принимает к клирингу новые сделки.
 - 22.5.2. СПВБ незамедлительно информирует участников торгов и клиринга о прекращении клиринга сделок и не принимает к клирингу новые сделки.
 - 22.5.3. СПВБ, используя при необходимости, резервные источники данных, передает в расчетные организации и расчетные депозитарии поручения, основанные на сведениях клиринговых регистров об обязательствах и требованиях участников клиринга.
 - 22.5.4. СПВБ незамедлительно уведомляет Банк России о приостановлении или прекращении оказания значимых клиринговых услуг в порядке, предусмотренном разделом 24 Правил управления рисками.
- 22.6. В соответствии с Уставом для покрытия убытков СПВБ, а также погашения облигаций и выкупа акций СПВБ в случае отсутствия иных средств, на СПВБ создается Резервный фонд в размере 25% от установленного в пункте 2 статьи 4 Устава размера уставного капитала.
- 22.7. Резервный фонд формируется путем ежегодных отчислений в размере 5% от чистой прибыли до достижения установленного в пункте 1 статьи 7 Устава размера.
- 22.8. По решению общего собрания акционеров СПВБ могут создаваться иные фонды.
- 22.9. Все вопросы, связанные с использованием Резервного фонда СПВБ, решаются Советом директоров.
- 23. ПОРЯДОК ВЗАИМОДЕЙСТВИЯ С ОРГАНИЗАЦИЯМИ, ОТ ДЕЙСТВИЙ КОТОРЫХ ЗАВИСИТ КАЧЕСТВО ПРИМЕНЯЕМЫХ МЕР, НАПРАВЛЕННЫХ НА ОБЕСПЕЧЕНИЕ ИЛИ ВОССТАНОВЛЕНИЕ НЕПРЕРЫВНОСТИ ОКАЗАНИЯ ЗНАЧИМЫХ УСЛУГ**
- 23.1. Список расчетных организаций и расчетных депозитариев, с которыми взаимодействует СПВБ при осуществлении клиринговой деятельности, определен в Правилах клиринга.
 - 23.2. Порядок взаимодействия с расчетными организациями и расчетными депозитариями определяется Правилами клиринга и соответствующими договорами.
 - 23.3. Меры, принимаемые СПВБ в чрезвычайных ситуациях и направленные на обеспечение непрерывности осуществления деятельности СПВБ, определены в документе «План обеспечения непрерывности и восстановления деятельности Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа», который определяет порядок взаимодействия с коммунальными, аварийными и специализированными службами в чрезвычайных ситуациях.
- 24. ПОРЯДОК УВЕДОМЛЕНИЯ БАНКА РОССИИ**
- 24.1. В случае наступления обстоятельств, которые могут привести к приостановлению или прекращению оказания значимых клиринговых услуг, СПВБ отправляет в Банк России уведомление о приостановлении или прекращении оказания значимых клиринговых услуг в день принятия решения о начале реализации соответствующих мер.
 - 24.2. Уведомление предоставляется в Банк России через личный кабинет СПВБ в виде электронного документа в формате Adobe Acrobat Reader (*.pdf), подписанного усиленной квалифицированной

электронной подписью в соответствии с Федеральным законом от 06.04.2011 №63-ФЗ «Об электронной подписи», без предоставления на бумажном носителе.

- 24.3. Порядок уведомления Банка России о возникновении технических сбоев в период проведения торгов определяется в Порядке взаимодействия между подразделениями Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» при возникновении нестандартных ситуаций.





Прошито, пронумеровано и скреплено печатью

18 (восемнадцатимь) листа(ов)

«28» ноября 2018 г.

Управляющий АО СФНБ


/Еганов Сергей Борисович/

