

Центральный Банк  
Российской Федерации (Банк России)  
**ЗАРЕГИСТРИРОВАНО**  
Дата 15 октября 2019

УТВЕРЖДЕНО

Управляющий  
Акционерного общества  
«Санкт - Петербургская Валютная Биржа»



/П.Б.Бунин/

Приказ № 01-34/19 от 12.09.2019



Правила внутреннего контроля  
Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа»

(новая редакция)

## Оглавление

1. Общие положения.....	3
2. Цели, задачи и методы осуществления внутреннего контроля .....	4
3. Требования к Контролеру.....	5
4. Перечень функций Контролера.....	6
5. Права и обязанности Контролера.....	7
6. Перечень мероприятий, направленных на обеспечение независимости Контролера .....	8
7. Порядок выявления, анализа, оценки и мониторинга регуляторного риска деятельности СПВБ .....	8
8. Порядок и критерии признания событий и последствий таких событий регуляторного риска деятельности СПВБ существенными .....	12
9. Порядок учета событий, связанных с регуляторным риском деятельности СПВБ.....	13
10. Особенности организации и осуществления внутреннего контроля при совмещении СПВБ клиринговой деятельности с деятельностью по проведению организованных торгов.....	14
11. План деятельности Контролера по управлению регуляторным риском .....	14
12. Порядок и сроки подготовки и направления Управляющему СПВБ на рассмотрение отчетов.....	14
13. Порядок информирования Совета директоров .....	15
14. Порядок и периодичность пересмотра Правил внутреннего контроля.....	15
15. Порядок выполнения структурными подразделениями (работниками структурных подразделений) и должностными лицами СПВБ требований Контролера, связанных с осуществлением им своих функций.....	16
16. Меры, предпринимаемые СПВБ для обеспечения конфиденциальности информации, полученной Контролером при осуществлении внутреннего контроля.....	16
17. Приложение №1 .....	17
18. Приложение №2 .....	18
19. Приложение №3 .....	19
20. Приложение №4 .....	20
21. Приложение №5 .....	21

## **1. Общие положения**

1.1. Настоящие Правила внутреннего контроля Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» (далее по тексту – Правила внутреннего контроля) разработаны на основе Федеральных законов от 21.11.2011 №325-ФЗ «Об организованных торгах», от 07.02.2011 №7-ФЗ «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте», от 27.07.2010 №224-ФЗ «О противодействии неправомерному использованию инсайдерской информации и манипулированию рынком и о внесении изменений в отдельные законодательные акты Российской Федерации» (далее по тексту - Законодательство Российской Федерации), нормативных актов Банка России, учредительных документов и иных документов, регламентирующих деятельность Акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» (далее по тексту - СПВБ) на финансовых рынках.

1.2. Правила внутреннего контроля определяют порядок организации и осуществления внутреннего контроля за соответствием деятельности СПВБ, осуществляемой на основании лицензии биржи, выданной Банком России, и лицензии на осуществление клиринговой деятельности, выданной ФСФР России, требованиям Законодательства Российской Федерации и принятым в соответствии с ними нормативным актам Банка России, учредительным документам и иным внутренним документам, регламентирующих деятельность СПВБ по организации торговли и клиринговой деятельности.

1.3. Правила внутреннего контроля, изменения и дополнения к ним, а также новые редакции утверждаются Управляющим СПВБ и подлежат регистрации в Банке России.

1.4. Правила внутреннего контроля изменения и дополнения к ним, а также новые редакции раскрываются на официальном сайте СПВБ в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» после их регистрации в Банке России в течение пяти рабочих дней с даты получения СПВБ официального решения Банка России (или его копии) о регистрации Правил внутреннего контроля, но не позднее, чем за три рабочих дня до даты вступления их в силу.

1.5. Правила внутреннего контроля изменения и дополнения к ним, а также новые редакции вступают в силу с даты, определяемой Управляющим СПВБ.

## **2. Цели, задачи и методы осуществления внутреннего контроля**

2.1. Целью осуществления внутреннего контроля СПВБ является соблюдение СПВБ требований Законодательства Российской Федерации, принятым в соответствии с ними нормативных актов Банка России, учредительных документов и иных внутренних документов, регламентирующих деятельность СПВБ по организации торговли и клиринговой деятельности.

2.2. Задачами внутреннего контроля СПВБ являются:

обеспечение соблюдения СПВБ требований Законодательства Российской Федерации, принятым в соответствии с ними нормативных актов Банка России, учредительных и внутренних документов, регламентирующих деятельность СПВБ по организации торговли и клиринговой деятельности;

исключение вовлечения СПВБ и его работников в осуществление противоправной и недобросовестной деятельности, в том числе в легализацию (отмывание) доходов, полученных преступным путем, и финансирование терроризма;

исключение неправомерного использования инсайдерской информации и(или) манипулирования рынком;

обеспечение исключения конфликта интересов, в том числе выявление и контроль конфликта интересов, а также предотвращение его последствий.

2.3. В рамках организации и осуществления внутреннего контроля СПВБ Управляющим СПВБ назначается контролер СПВБ (далее по тексту – Контролер), который осуществляет выявление, анализ, оценку, мониторинг риска возникновения у СПВБ расходов (убытков) и (или) иных неблагоприятных последствий в результате несоответствия СПВБ или несоответствия деятельности СПВБ, осуществляемой СПВБ на основании лицензии биржи и лицензии на осуществление клиринговой деятельности требованиям Законодательства Российской Федерации, принятым в соответствии с ними нормативным актам Банка России, учредительным и внутренним документам СПВБ, связанным с осуществлением деятельности по организации торговли и клиринговой деятельности, а также в результате применения в отношении СПВБ мер со стороны Банка России (далее - регуляторный риск деятельности СПВБ), а также обеспечивает управление таким риском.

2.4. К методам осуществления внутреннего контроля СПВБ относятся:

мониторинг деятельности структурных подразделений (работников структурных подразделений) СПВБ в целях определения источников возникновения регуляторного риска и управления регуляторным риском;

контроль исполнения предписаний (требований) Банка России;

мониторинг Законодательства Российской Федерации, принятых в соответствии с ним нормативных актов Банка России;

анализ соответствия действующих внутренних документов, связанных с осуществлением СПВБ деятельности по организации торговли и клиринговой деятельности, требованиям Законодательства Российской Федерации и принятым в соответствии с ними нормативным актам Банка России;

участие в разработке внутренних документов СПВБ, направленных на соблюдение сотрудниками норм профессиональной этики и поддержание деловой репутации, противодействие коммерческому подкупу и коррупции, противодействие мошенничеству в сфере профессиональной деятельности СПВБ;

участие в мероприятиях, направленных на предотвращение конфликта интересов в деятельности СПВБ.

2.5. Деятельность Контролера осуществляется на принципах:

непрерывности – осуществление мероприятий внутреннего контроля постоянно, последовательно и регулярно;

своевременности – незамедлительного сообщения и принятия мер к устранению выявленных нарушений и регуляторных рисков;  
беспристрастности – при отсутствии конфликта интересов, без вмешательства органов управления, структурных подразделений и работников СПВБ;  
независимости – под непосредственным контролем Управляющего СПВБ при отсутствии зависимости от других подразделений и должностных лиц СПВБ;  
ответственности Контролера за надлежащее выполнение своих обязанностей.

### **3. Требования к Контролеру**

3.1. На должность Контролера назначается штатный сотрудник СПВБ, для которого СПВБ является основным местом работы, обладающий необходимыми знаниями, имеющий высшее образование, соответствующий требованиям, установленным Банком России к профессиональному опыту и квалификационным требованиям к Контролеру по видам профессиональной деятельности, осуществляемым СПВБ на финансовых рынках.

3.2. Контролер не может являться:

лицом, которое осуществляло функции единоличного исполнительного органа, входило в состав коллегиального исполнительного органа или осуществляло функции руководителя службы внутреннего контроля (контролера) финансовых организаций в момент совершения этими организациями нарушений, за которые у них были аннулированы (отозваны) лицензии на осуществление соответствующих видов деятельности, или нарушений, за которые было приостановлено действие указанных лицензий и указанные лицензии были аннулированы (отозваны) вследствие неустранения этих нарушений, если со дня такого аннулирования прошло менее трех лет или если в отношении указанного лица имеются вступившие в законную силу судебные решения, установившие факты совершения указанным лицом правонарушений при банкротстве, преднамеренного и (или) фиктивного банкротства;

лицом, в отношении которого не истек срок, в течение которого оно считается подвергнутым административному наказанию в виде дисквалификации;

лицом, имеющим судимость за преступления в сфере экономической деятельности или преступления против государственной власти;

лицом, у которого был аннулирован квалификационный аттестат, выданный Банком России, если со дня такого аннулирования прошло менее трех лет.

3.3. Контролером не может являться лицо, осуществляющее функции единоличного исполнительного органа СПВБ, или руководитель структурного подразделения СПВБ, осуществляющего деятельность по проведению организованных торгов или клиринговой деятельности.

3.4. На Контролера не могут быть возложены обязанности и (или) функции, исполнение которых может привести к возникновению конфликта интересов.

3.5. Привлечение третьих лиц для осуществления отдельных функций в рамках внутреннего контроля не производится.

3.6. Для обеспечения непрерывности осуществления внутреннего контроля, в случае временного отсутствия Контролера приказом Управляющего СПВБ назначается лицо из числа штатных сотрудников СПВБ, исполняющее обязанности Контролера, не имеющее конфликта интересов в течение всего периода осуществления им функций Контролера и отвечающего требованиям, предъявляемым к Контролеру, указанным в настоящем разделе Правил внутреннего контроля.

В случае отсутствия Контролера более двух месяцев подряд, за исключением его отсутствия в течение указанного времени по причине временной нетрудоспособности, назначается новый Контролер, в порядке, установленном Законодательством Российской Федерации и нормативными актами Банка России.

#### **4. Перечень функций Контролера**

4.1. Организация процессов, направленных на выявление, анализ, оценку, мониторинг и управление регуляторным риском деятельности СПВБ, в том числе разработка и контроль выполнения мероприятий, направленных на предупреждение и предотвращение последствий реализации регуляторного риска деятельности СПВБ.

В рамках управления регуляторным риском деятельности СПВБ Контролер должен осуществлять мониторинг деятельности структурных подразделений (работников структурных подразделений) СПВБ в целях управления регуляторным риском и определения источников возникновения регуляторного риска, в том числе на предмет соблюдения сроков представления отчетности в Банк России, порядка и сроков раскрытия информации, требований к размеру, порядку и срокам расчета собственных средств СПВБ, а также контролировать исполнение предписаний (требований) Банка России.

4.2. Ведение учета событий, связанных с регуляторным риском деятельности СПВБ.

4.3. Определение вероятности возникновения событий, связанных с регуляторным риском деятельности СПВБ, и количественная оценка возможных последствий, связанных с их возникновением.

4.4. Информирование Управляющего СПВБ о вероятных и (или) наступивших событиях регуляторного риска деятельности СПВБ, приведших (способных привести) к последствиям, признанным СПВБ существенными, в том числе к возникновению у СПВБ и (или) ее клиентов (контрагентов) расходов (убытков), признанных СПВБ существенными (далее - существенные события регуляторного риска деятельности СПВБ), в течение рабочего дня с момента обнаружения вероятности наступления и (или) наступления указанных событий.

4.5. Анализ соблюдения СПВБ прав клиентов в рамках осуществления деятельности СПВБ.

4.6. Участие в рассмотрении обращений (в том числе жалоб), запросов и заявлений, связанных с деятельностью СПВБ, в части выявления регуляторного риска деятельности СПВБ, а также анализ статистики указанных обращений, запросов и заявлений (при их наличии).

4.7. Участие в мероприятиях, направленных на предотвращение конфликта интересов в деятельности СПВБ.

4.8. Участие в разработке внутренних документов СПВБ, направленных на соблюдение работниками СПВБ норм профессиональной этики и поддержание деловой репутации, противодействие коммерческому подкупу и коррупции, а также мошенничеству в деятельности СПВБ по организации торговли и клиринговой деятельности.

4.9. Анализ проектов внутренних документов, связанных с осуществлением деятельности СПВБ по организации торговли и клиринговой деятельности, Правил внутреннего контроля, в целях выявления регуляторного риска деятельности СПВБ.

4.10. Разработка и представление на рассмотрение Управляющему СПВБ в объеме, порядке и сроки, указанные в разделах 11 и 12 настоящих Правил внутреннего контроля, следующих документов:

плана деятельности Контролера, а также изменения в него;

отчета о выявленных существенных событиях регуляторного риска деятельности СПВБ, содержащего рекомендации о мерах, необходимых для недопущения и (или) предотвращения таких событий;

отчета о деятельности Контролера, содержащего рекомендации по управлению регуляторным риском деятельности СПВБ, информацию о принятых мерах, направленных на снижение или отказ от регуляторного риска деятельности СПВБ, и о результатах мониторинга деятельности структурных подразделений (работников структурных подразделений) СПВБ, осуществляемого в рамках управления регуляторным риском деятельности СПВБ.

4.11. Участие в рамках своей компетенции во взаимодействии СПВБ с Банком России.

4.12. Информирование Управляющего СПВБ о всех случаях, препятствующих осуществлению функций Контролера.

4.13. Информирование Совета директоров СПВБ о регуляторных рисках деятельности СПВБ.

4.14. Осуществление контроля за соблюдением требований Федерального закона от 27 июля 2010 года №224-ФЗ «О противодействии неправомерному использованию инсайдерской информации и манипулированию рынком и о внесении изменений в отдельные законодательные акты Российской Федерации» и принятых в соответствии с ним нормативных актов Банка России.

## **5. Права и обязанности Контролера**

5.1. При осуществлении своей деятельности Контролер вправе:

выносить на рассмотрение органов управления СПВБ вопросы, связанные с осуществлением внутреннего контроля;

запрашивать у работников и членов органов управления СПВБ информацию (документы), необходимые для осуществления внутреннего контроля;

запрашивать информацию, а также любые сведения, имеющиеся в информационных системах, базах данных и регистрах, непосредственно связанных с осуществлением деятельности СПВБ на финансовых рынках, снимать копии с полученных документов, файлов и записей, за исключением информации, не подлежащей копированию в соответствии с требованиями законодательства Российской Федерации;

получать необходимую информацию от всех работников СПВБ, связанную с исполнением ими должностных обязанностей при осуществлении деятельности организатора торговли и клиринговой деятельности;

получать от работников СПВБ письменные объяснения по вопросам, возникающим в ходе исполнения им своих обязанностей.

5.2. При осуществлении своей деятельности Контролер обязан:

соблюдать требования Законодательства Российской Федерации, нормативных актов Банка России, регулирующих деятельность по осуществлению внутреннего контроля;

надлежащим образом выполнять свои функции;

соблюдать требования Правил внутреннего контроля и иных документов о внутреннем контроле, утвержденных уполномоченным органом СПВБ;

обеспечивать сохранность и возврат полученных в подразделениях СПВБ оригиналов документов, файлов и записей;

соблюдать режим конфиденциальности в отношении полученной инсайдерской и (или) служебной и (или) составляющей коммерческую тайну информации;

информировать Управляющего СПВБ о всех случаях, которые препятствуют осуществлению Контролером своих функций;  
информировать Управляющего СПВБ, Правление СПВБ, Совет директоров СПВБ о регуляторных рисках деятельности СПВБ;  
участвовать в разработке документов СПВБ по внутреннему контролю.

## **6. Перечень мероприятий, направленных на обеспечение независимости Контролера**

6.1. Контролер назначается на должность и освобождается от должности Управляющим СПВБ.

6.2. Контролер подотчетен Управляющему СПВБ, при этом Управляющий СПВБ:  
утверждает Правила внутреннего контроля и иные внутренние документы СПВБ, касающиеся внутреннего контроля;  
утверждает планы работы Контролера;  
знакомится с отчетами Контролера;  
назначает Контролера с предварительного согласия Банка России и освобождает от должности Контролера;  
обеспечивает Контролера необходимыми и достаточными ресурсами (материальными, техническими) для достижения целей и решения задач внутреннего контроля СПВБ, установленных Правилами внутреннего контроля;  
обеспечивает Контролера доступом к информации, необходимой для осуществления им своих функций;  
обеспечивает независимость Контролера от иных сотрудников СПВБ, деятельность которых непосредственно связана с возникновением рисков СПВБ, в том числе посредством установления системы оплаты труда и структуры вознаграждения.

6.3. Контролер независим от других должностных лиц и структурных подразделений СПВБ. Решение поставленных перед Контролером задач производится без вмешательства со стороны органов управления, подразделений и работников СПВБ.

6.4. Работники СПВБ не имеют права препятствовать осуществлению Контролером своих функций. О каждом случае препятствования выполнению своих функций Контролер незамедлительно информирует Управляющего СПВБ.

## **7. Порядок выявления, анализа, оценки и мониторинга регуляторного риска деятельности СПВБ**

7.1. Выявление, анализ, оценка, мониторинг регуляторного риска деятельности СПВБ, управление и принятие решений по управлению регуляторным риском, осуществляется в рамках системы управления рисками СПВБ.

7.2. Процессы выявления, анализа, оценки, мониторинга, контроля и воздействия на регуляторные риски, а также управления регуляторными рисками, связанными с деятельностью СПВБ как организатора торговли и клиринговой организации осуществляются на постоянной основе.

7.3. Выявление (идентификация) регуляторных рисков включает обнаружение, распознавание и описания рисков. Выявление включает распознавание источников и видов риска, событий, причин и возможных последствий реализации риска.

7.4. В порядке выявления регуляторного риска Контролер осуществляет:  
постоянный мониторинг изменений Законодательства Российской Федерации и принятых в соответствии с ними нормативных актов Банка России, связанными с

деятельностью СПВБ как организатора торговли и клиринговой организации;  
постоянный мониторинг деятельности структурных подразделений СПВБ;  
постоянный мониторинг изменений внутренних документов СПВБ;  
анкетирование руководителей структурных подразделений СПВБ;  
анализ новых направлений и услуг СПВБ с точки зрения возможных регуляторных рисков.

7.5. Выявление регуляторных рисков осуществляется также на основе информации о вероятных или наступивших событиях регуляторного риска деятельности СПВБ, которую сотрудники структурных подразделений и должностные лица СПВБ обязаны незамедлительно доводить до сведения Контролера.

7.6. По результатам осуществления мероприятий, указанных в пунктах 7.4. и 7.5. Правил внутреннего контроля, Контролером устанавливаются события, связанные с возникновением регуляторного риска деятельности СПВБ, определяются вид и источник возникновения риска.

7.7. После определения вида и источника возникновения регуляторного риска деятельности СПВБ Контролером проводится анализ регуляторного риска. Для анализа регуляторного риска при необходимости используется метод экспертных оценок. В качестве экспертов могут привлекаться риск-менеджер, работники договорно-правового отдела и других структурных подразделений СПВБ.

7.8. Результаты анализа выявленного регуляторного риска содержат следующую информацию:

- классификация риска;
- сценарий (содержание риска);
- вероятность возникновения (реализации) риска;
- возможный убыток;
- уровень риска;
- наименование индикатора (контрольного параметра) риска;
- пороговое значение индикатора (если есть);
- ответственное подразделение (лицо);
- контролирующее подразделение (лицо);
- источник данных для контроля;
- периодичность контроля;
- метод воздействия на риск.

7.9. Информация о выявленных регуляторных рисках, полученная в результате анализа, приводится в Реестре регуляторных рисков, который ведет Контролер на постоянной основе. Реестр регуляторных рисков рассматривается Правлением СПВБ по предложению Контролера и утверждается Управляющим СПВБ. Примерная форма Реестра регуляторных рисков приведена в Приложении №1 к Правилам внутреннего контроля.

7.10. Информация о вновь выявленных регуляторных рисках вносится Контролером в Реестр регуляторных рисков в течение 3 рабочих дней с момента выявления и анализа риска. Контролер не реже одного раза в год осуществляет оценку Реестра регуляторных рисков на предмет его актуальности.

7.11. Контролер производит оценку регуляторных рисков деятельности СПВБ ежеквартально до 25 числа месяца, следующего за отчетным кварталом.

7.12. Для оценки регуляторных рисков используется матрица последствий и вероятностей (карта рисков), метод экспертных оценок, анализ воздействия на бизнес.

7.13. Критерии оценки регуляторных рисков определяются Контролером на основании статистических данных деятельности СПВБ и экспертных оценок.

7.14. Регуляторные риски ранжируются по вероятности возникновения риска в течение ближайшего года и по степени серьезности возможного убытка, к которому может привести реализация риска.

7.15. Для оценки вероятности наступления событий регуляторного риска в течение ближайшего года рассматриваются статистические данные деятельности СПВБ, а также экспертные оценки.

7.16. В зависимости от частоты реализации риска в прошлом, регуляторный риск относится к одной из следующих категорий:

- незначительный риск;
- маловероятный риск;
- вероятный риск;
- высоковероятный риск;
- ожидаемый риск.

При этом принимается, что вероятность возникновения регуляторного риска в течение ближайшего года равна частоте реализации риска в прошлом.

Категории регуляторных рисков по вероятности возникновения риска приведены в Приложении №5 к Правилам внутреннего контроля.

7.17. Регуляторные риски также ранжируются по степени серьезности возможного убытка (количественная оценка возможных последствий). Для оценки возможного убытка используются статистические данные деятельности СПВБ, а также экспертные оценки.

7.18. В качестве базового параметра при ранжировании регуляторных рисков по возможным убыткам используется размер собственных средств СПВБ на конец последнего календарного года.

7.19. Регуляторные риски в зависимости от отношения возможного убытка к размеру собственных средств СПВБ относятся к одной из следующих категорий:

- минимальный убыток;
- умеренный убыток;
- существенный убыток;
- критический убыток;
- катастрофический убыток.

Категории регуляторных рисков по степени серьезности возможного убытка приведены в Приложении №5 к Правилам управления рисками.

7.20. Для сопоставления результатов оценки выявленных регуляторных рисков с установленными критериями оценки (вероятности возникновения риска, степени серьезности возможного убытка, а также существенности последствий) Контролером строится матрица последствий и вероятностей (карта рисков) в форме, приведенной в Приложении №4 к Правилам внутреннего контроля. Карта рисков используется при выборе метода управления риском, а также для определения рисков, не требующих дальнейшего рассмотрения (незначительных рисков).

7.21. Карта рисков имеет две шкалы: вертикальную – «шкалу вероятности возникновения риска в течение ближайшего года» и горизонтальную – «шкалу степени серьезности возможного убытка». Каждое поле карты рисков характеризуется своим уровнем риска. Карта рисков делится на три области (уровня) риска:

область высокого риска;  
область среднего риска;  
область низкого риска.

7.22. После проведения Контролером идентификации и анализа регуляторные риски в соответствии с вероятностью возникновения (реализации риска) и возможным убытком относятся к одной из трех указанных областей (уровней) риска.

7.23. СПВБ устанавливается предельный размер (допустимый уровень) регуляторного риска. Под предельным размером риска (допустимым уровнем) понимается уровень риска, который СПВБ готова нести в процессе деятельности. Для регуляторного риска деятельности СПВБ предельным размером риска (допустимым уровнем) является средний уровень риска.

Значение предельного размера регуляторного риска определяется по формуле:

$PRPP = K_{pp} * PCC$ , где:

PRPP – предельный размер регуляторного риска;  
 $K_{pp}$  – коэффициент предельного размера регуляторного риска;  
PCC – размер собственных средств СПВБ на конец последнего календарного года.

Значения коэффициента  $K_{pp}$  определяется экспертным путем и утверждаются приказом Управляющего СПВБ.

При определении коэффициента предельного размера регуляторного риска учитывается:

размер вступивших в силу постановлений о наложении штрафов за нарушение Законодательства Российской Федерации и принятых в соответствии с ними нормативных актов Банка России;

размер сумм требований по вступившим в силу судебным решениям, связанным с нарушением СПВБ договорных обязательств перед участниками торгов, участниками клиринга на СПВБ;

наличие в течение года неснятых с контроля предписаний Банка России об устранении нарушений требований Законодательства Российской Федерации и принятым в соответствии с ними нормативных актов Банка России, срок исполнения по которым наступил и решений Банка России о продлении срока исполнения которых не принято.

7.24. Контролером по каждому из регуляторных рисков, путем нанесения на карту рисков всех выявленных регуляторных рисков, ежеквартально определяется размер риска. Размер риска по каждому отдельному виду регуляторных рисков рассчитывается как сумма произведений размера возможного убытка на вероятность реализации риска в течение ближайшего года. Сумма размеров отдельных видов регуляторного риска сравнивается с установленным значением предельного размера регуляторного риска, определенного в соответствии с пунктом 7.23. Правил внутреннего контроля.

7.25. Порядок управления регуляторным риском деятельности СПВБ и принятия решений при управлении регуляторным риском.

В случае выявления превышения размера риска предельного размера (допустимого уровня) регуляторного риска, указанного в пункте 7.24., Контролер в течение одного рабочего дня информирует об этом Управляющего СПВБ устно или по электронной почте или в виде служебной записки.

Контролер разрабатывает рекомендации по возможным способам воздействия на регуляторный риск, необходимым для снижения риска, а также устранения последствий его реализации.

Контролер также инициирует проведение заседания Правления СПВБ для

рассмотрения фактов указанного превышения предельного размера риска и принятия решений по возможным способам воздействия на регуляторный риск (снижение риска, принятие риска, изменения предельного размера риска).

7.26. С целью реализации мер по управлению регуляторным риском Контролер разрабатывает План по управлению регуляторным риском деятельности СПВБ в рамках системы управления рисками СПВБ. (далее - План по управлению регуляторным риском), который содержит список выявленных регуляторных рисков, мероприятия по управлению регуляторным риском, критерии успешности управления регуляторным риском, ответственных сотрудников (подразделения) СПВБ и сроки проведения мероприятий. План по управлению регуляторным риском утверждается Управляющим СПВБ и пересматривается в случае необходимости, но не реже одного раза в год.

7.27. Контролер ежеквартально до 25 числа месяца, следующего за отчетным кварталом, информирует риск-менеджера о результатах оценки регуляторных рисков.

7.28. Мониторинг регуляторного риска и контроль за управлением регуляторным риском деятельности СПВБ и принимаемыми мерами, направленными на предупреждение и предотвращение последствий реализации регуляторного риска, производится Контролером на постоянной основе.

7.29. В целях соответствия деятельности СПВБ регуляторным требованиям Контролером производится:

мониторинг изменения требований Законодательства Российской Федерации и принятым в соответствии с ними нормативных актов Банка России в справочно - правовой системе «Консультант плюс», на официальном сайте Банка России в информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» и доведение этих изменения до руководителей структурных подразделений СПВБ;

анализ проектов внутренних нормативных документов СПВБ, связанных с осуществлением СПВБ деятельности по организации торгов и клиринговой деятельности.

7.30. В порядке мониторинга регуляторного риска Контролером также производится ведение Реестра регуляторных рисков, Журнала событий регуляторного риска, использование чек - листов контроля проводимых мероприятий и мер, направленных на предупреждение и предотвращение последствий реализации регуляторного риска.

## **8. Порядок и критерии признания событий и последствий таких событий регуляторного риска деятельности СПВБ существенными**

8.1. Существенные события регуляторного риска деятельности СПВБ - события регуляторного риска деятельности СПВБ, приведшие (способные привести) к последствиям, признанным СПВБ существенными.

8.2. События регуляторного риска признаются существенными, при наступлении (возможности наступления) которых происходит превышение предельного размера (допустимого уровня) регуляторного риска, определенного в порядке, изложенном в пункте 7.23. Правил внутреннего контроля.

8.3. Последствия событий регуляторного риска признаются существенными, в случае отнесения их к существенному, критическому или катастрофическому убытку, определенному в соответствии с пунктом 7.19. Правил внутреннего контроля.

8.4. События и последствия событий регуляторного риска также признаются существенными, если в результате реализации (возможности реализации) таких событий получено (имеется вероятность получения) предписание Банка России о приостановке или прекращении деятельности по организации торговли или клиринговой деятельности.

8.5. Существенные события регуляторного риска могут проявляться в виде:  
нарушений требований Законодательства Российской Федерации и принятых в соответствии с ними нормативных актов Банка России;  
нарушений положений учредительных и внутренних документов СПВБ, связанных с осуществлением деятельности по организации торговли и клиринговой деятельности;  
нарушений сроков представления отчетности в Банк России;  
нарушений порядка и сроков раскрытия информации;  
нарушений требований к размеру, порядку и срокам расчета собственных средств СПВБ;  
неисполнения предписаний (требований) Банка России.

8.6. Контролер устно или посредством электронной почты или в виде служебной записки информирует Управляющего СПВБ о вероятных и (или) наступивших существенных событиях регуляторного риска в течение рабочего дня с момента обнаружения вероятности наступления и (или) наступления указанных событий.

Контролер производит описание существенных событий регуляторного риска и их последствий, разрабатывает рекомендации по возможным способам минимизации последствий реализации (возможной реализации) существенных событий регуляторного риска.

Контролер также инициирует проведение заседания Правления СПВБ:

для рассмотрения фактов наступления (возможного наступления) событий регуляторного риска, их последствий и принятия решения о признании их существенными;

для принятия решений по возможным способам воздействия, направленных на исключение (минимизацию) последствий (возможных последствий) существенных событий регуляторного риска.

## **9. Порядок учета событий, связанных с регуляторным риском деятельности СПВБ**

9.1. Руководители структурных подразделений исходя из задач и функций, возложенных на структурное подразделение при реализации внутренних процедур, в рамках своей компетенции определяют вероятные и (или) наступившие события регуляторного риска деятельности СПВБ.

9.2. Руководители структурных подразделений и должностные лица СПВБ устно, по электронной почте или в виде служебной записки предоставляют информацию Контролеру о вероятных и (или) наступивших событиях регуляторного риска деятельности СПВБ в течение рабочего дня с момента обнаружения вероятности наступления или наступления события регуляторного риска, а также информируют о фактах, которые могли привести к событиям регуляторного риска, о фактах нарушения требований Законодательства Российской Федерации, принятых в соответствии с ними нормативных актов Банка России и внутренних документов СПВБ.

9.3. Контролер осуществляет анализ представленной информации на предмет выявления регуляторных рисков деятельности СПВБ и в течение рабочего дня фиксирует в Журнале событий регуляторного риска наступившие события регуляторного риска деятельности СПВБ.

## **10. Особенности организации и осуществления внутреннего контроля при совмещении СПВБ клиринговой деятельности с деятельностью по проведению организованных торгов**

10.1. СПВБ совмещает клиринговую деятельность с деятельностью по организации торговли.

10.2. В связи с совмещением СПВБ клиринговой деятельности с деятельностью по организации торговли на СПВБ созданы отдельные структурные подразделения для осуществления этих видов деятельности.

10.3. На Контролера возложены функции контроля, связанные с осуществлением СПВБ клиринговой деятельности и деятельности по проведению организованных торгов.

## **11. План деятельности Контролера**

11.1. Контролер ежегодно в срок до 20 декабря текущего года разрабатывает и предоставляет на рассмотрение и утверждение Управляющему СПВБ план деятельности Контролера на следующий календарный год. План деятельности Контролера подлежит утверждению Управляющим СПВБ до начала календарного года, на который он разработан.

11.2. В случае необходимости внесения изменений в План деятельности Контролера, Контролер в течение 10 рабочих дней с момента определения такой необходимости вносит соответствующие изменения в План деятельности Контролера и предоставляет его в новой редакции Управляющему СПВБ на рассмотрение и утверждение. План деятельности Контролера в новой редакции подлежит утверждению Управляющим СПВБ в течение 5 рабочих дней.

## **12. Порядок и сроки подготовки и направления Управляющему СПВБ на рассмотрение отчетов**

12.1. Контролер предоставляет Управляющему СПВБ отчет о выявленных существенных событиях регуляторного риска деятельности СПВБ по форме, приведенной в Приложении №2 к Правилам внутреннего контроля, содержащий рекомендации о мерах, необходимых для недопущения и (или) предотвращения таких событий, не позднее рабочего дня, следующего за днем выявления указанных событий.

12.2. Контролер предоставляет Управляющему СПВБ отчет о деятельности Контролера за квартал по форме, приведенной в Приложении №3 к Правилам внутреннего контроля, содержащий сведения об оценке регуляторного риска деятельности СПВБ, а также рекомендации по управлению регуляторным риском, информацию о принятых мерах, направленных на снижение или отказ от регуляторного риска, о результатах мониторинга деятельности структурных подразделений (работников структурных подразделений) СПВБ, осуществляемого в рамках управления регуляторным риском, не позднее последнего дня месяца, следующего за отчетным кварталом.

12.3. Отчеты подготавливаются Контролером в письменном виде на бумажном носителе в 2 экземплярах.

12.4. После рассмотрения отчетов Управляющим СПВБ, экземпляры отчетов возвращаются Контролеру. Все экземпляры отчетов, представленные Контролером,

возвращаются Контролеру с отметками, свидетельствующими об утверждении (ознакомлении) Управляющим СПВБ соответствующих отчетов.

12.5. Контролер организует учет и хранение отчетов путем формирования отдельного дела отчетов Контролера.

Отчеты Контролера хранятся не менее 5 лет, если иное не установлено нормативными актами Банка России или нормативными правовыми актами Российской Федерации.

### **13. Порядок информирования Совета директоров**

13.1. Контролер предоставляет Совету директоров СПВБ информацию о регуляторных рисках деятельности СПВБ в письменном виде на бумажном носителе один раз в год не позднее 31 марта за предыдущий год.

13.2. Информация о регуляторных рисках деятельности СПВБ содержит информацию о результатах осуществления СПВБ процессов и мероприятий по управлению регуляторным риском, о мерах, принятых для его снижения, а также мерах, направленных на совершенствование управления таким риском.

### **14. Порядок и периодичность пересмотра Правил внутреннего контроля**

14.1. Пересмотр Правил внутреннего контроля на предмет соответствия требованиям Законодательства Российской Федерации, принятым в соответствии с ними нормативным актам Банка России, учредительным и внутренним документам СПВБ осуществляется Контролером не реже одного раза в год.

14.2. Контролер готовит заключение о соответствии (несоответствии) Правил внутреннего контроля требованиям Законодательства Российской Федерации, принятым в соответствии с ними нормативным актам Банка России, учредительным и внутренним документам СПВБ.

14.3. В случае выявления несоответствия Правил внутреннего контроля требованиям Законодательства Российской Федерации, принятым в соответствии с ними нормативным актам Банка России, учредительным и внутренним документам СПВБ, Контролер готовит рекомендации по изменению Правил внутреннего контроля и новую редакцию Правил внутреннего контроля. До вступления в силу новой редакции Правил внутреннего контроля, действующие Правила внутреннего контроля применяются в части, не противоречащей требованиям Законодательства Российской Федерации, принятым в соответствии с ними нормативным актам Банка России.

14.4. Контролер представляет Управляющему СПВБ заключение и рекомендации по изменению Правил внутреннего контроля в письменной форме не реже одного раза в год не позднее 31 марта.

**15. Порядок выполнения структурными подразделениями (работниками структурных подразделений) и должностными лицами СПВБ требований Контролера, связанных с осуществлением им своих функций**

15.1. Работники структурных подразделений и должностные лица СПВБ обязаны выполнять требования Контролера, связанные с осуществлением Контролером своих функций.

15.2. По требованию Контролера, выраженному в устной или письменной форме, работники структурных подразделений СПВБ и должностные лица СПВБ предоставляют Контролеру информацию (документы), в том числе анкеты и письменные объяснения по вопросам, связанным с деятельностью СПВБ по организации торговли и клиринговой деятельности в установленные сроки.

**16. Меры, предпринимаемые СПВБ для обеспечения конфиденциальности информации, полученной Контролером при осуществлении внутреннего контроля**

16.1. Контролер обеспечивает конфиденциальность информации, полученной им при осуществлении внутреннего контроля. Все внутренние документы, подготовленные Контролером, относятся к документам, содержащим служебную информацию ограниченного распространения, с присвоением им грифа «Конфиденциально», и обращаются с соответствующими ограничениями.

Реестр регуляторных рисков (примерная форма)

№ п/п	Вид риска / Краткое описание риска	Наименование индикатора (контрольного параметра) риска	Ответственное за управление риском подразделение (лицо)	Документы контроля риска	Периоди- чность контроля	Пороговое значение (если есть)

Форма отчета Контролера  
о выявленных существенных событиях  
регуляторного риска деятельности СПВБ

Конфиденциально

Управляющий АО СПВБ  
\_\_\_\_\_ Ф.И.О.  
« \_\_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

Отчет о выявленных существенных событиях регуляторного риска деятельности СПВБ

№ п/п	Дата выявления существенного события	Подразделение СПВБ, в котором выявлено существенное событие	Краткое описание существенного события	Рекомендации о мерах, необходимых для недопущения и (или) предотвращения существенного события
-------	--------------------------------------	---	--	--

Контролер АО СПВБ \_\_\_\_\_ Ф.И.О.  
« \_\_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

Форма отчета Контролера о деятельности за квартал

Конфиденциально

Управляющий АО СПВБ  
\_\_\_\_\_ Ф.И.О.  
«\_\_\_\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

Отчет о регуляторном риске АО СПВБ  
за \_\_\_ квартал \_\_\_ года

1. Оценка регуляторных рисков

№ п/п	Вид риска/Краткое описание риска	Наименование индикатора (контрольного параметра) риска	Ответственно за управление риском подразделение (лицо)	Документы контроля риска	Пороговое значение (если есть)	Значение индикатора за отчетный период	Уровень по виду риска за отчетный период, в % от стоимости активов	Предельный размер по виду риска, в % от стоимости активов
-------	----------------------------------	--	--	--------------------------	--------------------------------	--	--	---

2. Сведения о нарушениях АО 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 АО СПВБ, связанных с деятельностью по организации торговли и клиринговой деятельностью
3. Меры, принятые АО СПВБ для устранения выявленных нарушений и снижения регуляторных рисков
4. Сведения о выполнении рекомендаций по управлению регуляторными рисками

Контролер АО СПВБ \_\_\_\_\_ Ф.И.О.  
«\_\_\_\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

Матрица последствий и вероятностей (карта рисков)

	Минимальный убыток	Умеренный убыток	Существенный убыток	Критический убыток	Катастрофический убыток
Ожидаемый риск (вероятность события очень высокая, в течение года 75-100%)	//	//	/	/	/
Высоковероятный риск (вероятность события высокая, в течение года 50- 75%)	//	//	//	/	/
Вероятный риск (вероятность события средняя, в течение года 25- 50%)	///	//	//	//	/
Маловероятный риск (вероятность события низкая, в течение года 10- 25%)	///	///	//	//	//
Незначительный риск (вероятность события очень низкая, в течение года 0-10%)	///	///	///	//	//

I – область высокого риска

II – область среднего риска

III – область низкого риска

Категория регуляторного риска  
по вероятности возникновения риска в течение ближайшего года

Категория риска по вероятности возникновения риска в течение ближайшего года	Вероятность возникновения риска в течение ближайшего года	Частота реализации риска
Незначительный риск	<10%	примерно 1 раз в 10 лет или реже
Маловероятный риск	10-25%	чаще чем 1 раз в 10 лет, но не чаще чем 1 раз в 4 года
Вероятный риск	25-50%	чаще чем 1 раз в 4 года, но не чаще чем 1 раз в 2 года
Высоковероятный риск	50-75%	чаще чем 1 раз в 2 года, но не чаще чем 3 раза в 4 года
Ожидаемый риск	>75%	чаще чем 3 раза в 4 года

Категория регуляторного риска по степени серьезности возможного убытка

Категория риска по степени серьезности возможного убытка	Возможный убыток относительно размера собственных средств
Минимальный убыток	< 0,1%
Умеренный убыток	0,1% – 1%
Существенный убыток	1% – 5%
Критический убыток	5% – 10%
Катастрофический убыток	> 10%

