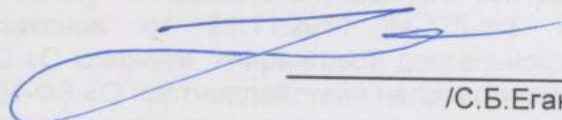


Центральный Банк
Российской Федерации (Банк России)
ЗАРЕГИСТРИРОВАНО

Дата 26 декабря 2018

УТВЕРЖДЕНО

Управляющий
Акционерного общества
«Санкт - Петербургская Валютная Биржа»


/С.Б.Еганов/

(Приказ № НД-3/18 от 26.11.2018)



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

(новая редакция)

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 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 принятых в соответствии с ними нормативных актов Банка России, учредительных документов и иных внутренних документов, регламентирующих деятельность СПВБ на финансовых рынках.

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 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.

РАЗДЕЛ I. ОБЩИЕ ВОПРОСЫ ОРГАНИЗАЦИИ ВНУТРЕННЕГО КОНТРОЛЯ

2. Цели, задачи и принципы осуществления внутреннего контроля СПВБ

2.1. Целью осуществления внутреннего контроля СПВБ является соблюдение СПВБ требований законодательства Российской Федерации и принятых в соответствии с ними нормативных актов Банка России, учредительных документов и иных внутренних документов, регламентирующих деятельность СПВБ на финансовых рынках.

2.2. Задачами внутреннего контроля СПВБ являются:
обеспечение соблюдения законодательства Российской Федерации, учредительных и внутренних документов СПВБ;
исключение вовлечения СПВБ и её сотрудников 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. Для осуществления внутреннего контроля СПВБ назначается контролер СПВБ (далее по тексту – Контролер).

2.4. 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 сотрудников 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. Контролер назначается на должность и освобождается от должности Управляющим СПВБ.

3.2. Назначение на должность Контролера допускается после предварительного согласия Банка России.

3.3. 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 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.

3.4. Для обеспечения непрерывности осуществления внутреннего контроля, в случае временного отсутствия Контролера приказом Управляющего СПВБ назначается лицо из числа штатных сотрудников СПВБ, исполняющее обязанности Контролера и не имеющее конфликта интересов в течение всего периода осуществления им функций Контролера.

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 действующим законодательством Российской Федерации.

3.5. 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.

3.6. 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.

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

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

3.9. Контролер независим от других должностных лиц и структурных подразделений СПВБ.

Для обеспечения независимости Контролера:

Контролер является заместителем Управляющего СПВБ;

решение поставленных перед Контролером задач производится без вмешательства со стороны органов управления, подразделений и работников СПВБ.

4. Права и обязанности Контролера

4.1. 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;

иметь доступ ко всем документам, ведущимся и хранящимся СПВБ базам данных и регистрам, непосредственно связанным с осуществлением деятельности СПВБ на финансовых рынках, а также 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;

требовать от работников СПВБ письменных объяснений по вопросам, возникающим в ходе исполнения им своих обязанностей.

4.2. 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 органы управления СПВБ обо всех случаях, которые препятствуют осуществлению Контролером своих функций;

информировать Управляющего СПВБ, Правление СПВБ, руководителя проверяемого структурного подразделения СПВБ о результатах проверок, проводимых в рамках внутреннего контроля деятельности СПВБ по организации торговли, а также Управляющего СПВБ, Правление СПВБ о регуляторных рисках при осуществлении СПВБ клиринговой деятельности;

участвовать в разработке документов СПВБ по внутреннему контролю.

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

5.1. Все внутренние документы, подготовленные Контролером, относятся к документам, содержащим служебную информацию ограниченного распространения, с присвоением им грифа «Конфиденциально», и обращаются с соответствующими ограничениями согласно Перечню мер, направленных на предотвращение неправомерного использования служебной информации СПВБ.

5.2. Контролер обеспечивает конфиденциальность информации, полученной им при осуществлении внутреннего контроля и содержащей инсайдерскую и/или служебную информацию и/или относящейся к коммерческой тайне, согласно Перечню мер, направленных на предотвращение неправомерного использования служебной информации СПВБ.

6. Порядок участия Контролера в разработке внутренних документов СПВБ

6.1. Контролер разрабатывает самостоятельно или совместно с руководителями структурных подразделений СПВБ изменения и дополнения к Правилам внутреннего контроля, а также их новые редакции.

6.2. Контролер может принимать участие в разработке иных внутренних документов, правил и внутренних операционных процедур СПВБ, связанных с деятельностью на финансовых рынках, а также оценивать разрабатываемые внутренние документы СПВБ, подлежащие регистрации в Банке России, на предмет соответствия законодательству Российской Федерации и нормативным актам Банка России.

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

7.1. Внутренний контроль СПВБ как организатора торговли осуществляется на основании части Правил внутреннего контроля «Раздел II. Внутренний контроль СПВБ как организатора торговли».

7.2. Внутренний контроль СПВБ как клиринговой организации, выявление, анализ, оценка, мониторинг регуляторного риска клиринговой организации и управление им осуществляется на основании части Правил внутреннего контроля «Раздел III. Внутренний контроль СПВБ как клиринговой организации».

7.3. Выявление, анализ, оценка, мониторинг регуляторного риска СПВБ как организатора торговли и управление им осуществляется на основании Правил организации системы управления рисками, связанными с осуществлением деятельности организатора торговли и клиринговой деятельности СПВБ.

8. Контроль за организацией и функционированием внутреннего контроля

8.1. Контроль за эффективностью процедур внутреннего контроля со стороны Совета директоров СПВБ осуществляет Комитет Совета директоров СПВБ по рискам и аудиту.

8.2. Контроль и оценку эффективности системы внутреннего контроля осуществляет Служба внутреннего аудита СПВБ.

9. Ответственность Контролера за нарушение требований по осуществлению внутреннего контроля

9.1. Контролер несет ответственность в соответствии с законодательством Российской Федерации и внутренними документами СПВБ:

за несоблюдение режима конфиденциальности в отношении инсайдерской и/или служебной и/или составляющей коммерческую тайну информации;

за невыполнение или ненадлежащее выполнение возложенных на него обязанностей, предусмотренных Правилами внутреннего контроля, в том числе за непредставление или несвоевременное представление отчетности Контролера.

РАЗДЕЛ II. ВНУТРЕННИЙ КОНТРОЛЬ СПВБ КАК ОРГАНИЗАТОРА ТОРГОВЛИ

10. Методы осуществления внутреннего контроля

10.1. К методам осуществления внутреннего контроля СПВБ как организатора торговли относятся:

проведение плановых и внеплановых проверок деятельности структурных подразделений СПВБ;

мониторинг деятельности структурных подразделений;

контроль за устранением выявленных нарушений и соблюдением мер по предупреждению аналогичных нарушений в дальнейшей деятельности СПВБ, исполнением рекомендаций по результатам проверок;

анализ проектов внутренних документов, связанных с осуществлением СПВБ деятельности на финансовых рынках;

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.

11. Функции Контролера

11.1. Контролер при осуществлении своей деятельности выполняет следующие функции:

проверка достоверности, полноты, объективности и своевременности представления отчетности СПВБ и иных сведений в соответствии с нормативными актами Банка России;

проверка соответствия внутренних документов СПВБ требованиям законодательства Российской Федерации, нормативных актов Банка России;

проверка порядка и сроков раскрытия информации СПВБ, установленных законодательством Российской Федерации, а также нормативными актами Банка России;

проверка исполнения предписаний Банка России;

проверка исполнения требований Банка России к размеру собственных средств СПВБ, а также иных расчетных нормативов и показателей, установленных Банком России;

проверка осуществления мер, направленных на предотвращение конфликта интересов при осуществлении СПВБ деятельности на финансовых рынках, а при наличии конфликта интересов - соблюдение приоритета интересов клиента;

проверка осуществления мер, направленных на предотвращение неправомерного использования инсайдерской и/или служебной информации при осуществлении СПВБ деятельности на финансовых рынках;

осуществляет иные функции по контролю за соблюдением СПВБ требований законодательства Российской Федерации, нормативных актов Банка России.

12. Порядок проведения проверок

12.1. Проверки, проводимые Контролером, предусматривают исследование определенного круга вопросов с целью выявления соответствия деятельности подразделения (сотрудника) СПВБ требованиям законодательства Российской Федерации, нормативных актов Банка России, внутренних документов СПВБ. Плановые проверки проводятся Контролером в соответствии с Планом проведения проверок Контролером. Внеплановые проверки проводятся по фактам выявленных нарушений.

Проведение проверок Контролером осуществляется в соответствии с Методикой проведения проверок Контролером.

12.2. Контролер не реже одного раза в 3 месяца осуществляет проверку соответствия деятельности СПВБ требованиям Федерального закона «Об организованных торгах», принятых в соответствии с ними нормативных актов Банка России, а также Уставу и внутренним документам СПВБ, регламентирующим деятельность СПВБ по организации торговли.

12.3. Контролер не реже одного раза в 3 месяца осуществляет проверку эффективности системы управления рисками СПВБ, за исключением стратегического риска СПВБ и риска потери деловой репутации организатора торговли. Проверка деятельности должностного лица, ответственного за организацию системы управления рисками СПВБ, осуществляется за 3 месяца, предшествующие проверке.

12.4. Порядок проведения проверок по выявленным нарушениям и контроля за исполнением рекомендаций Контролера.

12.4.1. Контролер незамедлительно уведомляет Управляющего СПВБ или лицо, его замещающее, о выявленном нарушении законодательства Российской Федерации, нормативных актов Банка России, внутренних документов СПВБ, после чего проводит оперативную проверку на предмет установления конкретного факта нарушения, причин совершения нарушения и виновных в нем лиц.

12.4.2. В ходе осуществления проверки анализируется деятельность проверяемого подразделения (сотрудника) СПВБ и исследуются документальные источники информации. При проведении проверки Контролер запрашивает у сотрудников необходимую информацию (документы), связанную с исполнением ими должностных обязанностей. При необходимости Контролер запрашивает у сотрудников СПВБ письменные объяснения по вопросам, возникающим в ходе проведения проверки.

12.4.3. Срок проведения оперативной проверки не может превышать пяти рабочих дней.

12.4.4. По итогам проверки составляется письменный отчет Контролера по выявленному нарушению, в котором отражаются выявленные нарушения и недостатки, причины выявленного нарушения с указанием виновных в нем должностных лиц, в целях последующего рассмотрения органами управления СПВБ для принятия мер.

12.4.5. Отчет Контролера может содержать принятые меры по устранению выявленных нарушений, а также рекомендации по предупреждению аналогичных нарушений в дальнейшей деятельности.

12.4.6. Контролером проводится последующий контроль результатов устранения выявленного нарушения, чтобы убедиться, что по выявленным недостаткам и нарушениям приняты соответствующие меры, обеспечивающие их исправление и устранение или устранены причины, обусловившие их появление.

12.4.7. Информация о выявленном ранее, но не устраненном нарушении, включается в последующий отчет Контролера о проверке.

13. Отчетность Контролера

13.1. Содержание отчетов о деятельности Контролера по результатам проверок.

13.1.1. Отчет о деятельности Контролера по результатам проверок содержит обобщенные сведения:

о проведенных за указанный период времени проверках, их результатах, причинах выявленных нарушений;

о принятых мерах по устранению выявленных нарушений, а также рекомендации по предупреждению аналогичных нарушений требований законодательства Российской Федерации.

Федерации, нормативных актов Банка России и внутренних документов СПВБ в дальнейшей деятельности;

о реализации мер, направленных на предотвращение неправомерного использования инсайдерской и/или служебной информации, манипулирования ценами, конфликта интересов, связанных с профессиональной деятельностью СПВБ на финансовых рынках;

о результатах проверок деятельности по управлению рисками.

13.1.2. В отчет могут быть включены рекомендации по повышению квалификации работников, улучшению организации внутреннего контроля СПВБ, а также иная информация.

13.1.3. Форма отчета о деятельности Контролера по результатам проверок приведена в Приложении №1 к Правилам внутреннего контроля.

13.2. Отчеты подготавливаются Контролером в письменной форме в 2 экземплярах.

13.3. Отчет по результатам проверок по фактам выявленных нарушений предоставляется Контролером Управляющему СПВБ в письменной форме не позднее 10 (десяти) дней с даты окончания соответствующей проверки.

13.4. Отчет по результатам проверок за квартал предоставляется Контролером Управляющему СПВБ в письменной форме не позднее 10 (десяти) дней с даты окончания соответствующего квартала.

13.5. После рассмотрения отчета Управляющим СПВБ, экземпляры отчетов возвращаются Контролеру. Все экземпляры отчетов, представленные Контролером, возвращаются Контролеру с отметками, свидетельствующими об ознакомлении Управляющего СПВБ с соответствующими отчетами.

13.6. 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.

РАЗДЕЛ III. ВНУТРЕННИЙ КОНТРОЛЬ СПВБ КАК КЛИРИНГОВОЙ ОРГАНИЗАЦИИ

14. Организация и осуществление внутреннего контроля СПВБ

14.1. Для обеспечения организации и осуществления внутреннего контроля СПВБ как клиринговой организации, Управляющим СПВБ назначается Контролер, который осуществляет выявление, анализ, оценку, мониторинг риска возникновения у СПВБ расходов (убытков) и (или) иных неблагоприятных последствий в результате ее несоответствия или несоответствия ее деятельности требованиям законодательства Российской Федерации о клиринговой деятельности, учредительным и внутренним документам, связанным с осуществлением клиринговой деятельности, и (или) применения в отношении клиринговой организации мер со стороны Банка России (далее - регуляторный риск СПВБ), а также обеспечивает управление таким риском.

15. Методы осуществления внутреннего контроля

15.1. К методам осуществления внутреннего контроля СПВБ как клиринговой организации относятся:

мониторинг деятельности структурных подразделений (работников структурных подразделений) СПВБ, в том числе на предмет соблюдения сроков представления отчетности в Банк России, порядка и сроков раскрытия информации, требований к размеру и порядку расчета собственных средств СПВБ в целях выявления регуляторного риска и определения источников его возникновения;

контроль исполнения предписаний (требований) Банка России;

анализ проектов внутренних документов, связанных с осуществлением СПВБ клиринговой деятельности;

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.

15.2. К основным методам управления регуляторным риском клиринговой деятельности, применяемым СПВБ, относятся:

принятие и учет риска;

разделение риска с другими сторонами;

отказ от риска;

финансирование риска (страхование, направление дополнительных ресурсов на проект, понижение уровня риска до приемлемого);

диверсификация риска.

16. Функции Контролера

16.1. К функциям Контролера при осуществлении СПВБ клиринговой деятельности относятся:

выявление, анализ, оценка, мониторинг регуляторного риска клиринговой деятельности СПВБ и управление им, в том числе разработка мероприятий, направленных на предупреждение и предотвращение последствий реализации регуляторного риска клиринговой деятельности, а также контроль выполнения этих мероприятий;

ведение учета событий, связанных с регуляторным риском клиринговой

деятельности;

определение вероятности возникновения событий, связанных с регуляторным риском клиринговой деятельности, и количественная оценка возможных последствий, связанных с их возникновением;

информирование Управляющего СПВБ о вероятных и (или) наступивших событиях регуляторного риска клиринговой деятельности, 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 клиринговой деятельности), в течение рабочего дня с момента обнаружения вероятности наступления и (или) наступления указанных событий;

анализ соблюдения СПВБ прав клиентов в рамках осуществления клиринговой деятельности;

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

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

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

анализ проектов внутренних документов, связанных с осуществлением клиринговой деятельности, документа, устанавливающего порядок осуществления СПВБ внутреннего контроля, в целях выявления регуляторного риска СПВБ;

разработка и представление на рассмотрение Управляющему СПВБ следующих документов:

- плана деятельности Контролера, а также изменения в него;
- отчета о выявленных существенных событиях регуляторного риска клиринговой деятельности, содержащего рекомендации о мерах, необходимых для недопущения и (или) предотвращения таких событий;
- отчета о деятельности Контролера, содержащего сведения о регуляторном риске клиринговой деятельности, а также рекомендации по управлению регуляторным риском клиринговой деятельности, информацию о принятых мерах, направленных на снижение или отказ от регуляторного риска клиринговой деятельности, и о результатах мониторинга деятельности структурных подразделений (работников структурных подразделений) СПВБ, осуществляемого в рамках управления регуляторным риском клиринговой деятельности;

участие в рамках своей компетенции во взаимодействии СПВБ с Банком России;

информирование Управляющего СПВБ обо всех случаях, препятствующих осуществлению функций Контролера;

информирование Совета директоров СПВБ о регуляторных рисках клиринговой организации;

выполнение иных функций, осуществляемых в рамках внутреннего контроля.

17. Порядок выявления, анализа, оценки и мониторинга регуляторного риска клиринговой деятельности, а также порядок управления регуляторным риском клиринговой деятельности, в том числе принятия решений клиринговой организацией в рамках управления таким риском

17.1. С целью выявления регуляторного риска клиринговой деятельности Контролер осуществляет:

фиксацию событий регуляторного риска;

постоянный мониторинг законодательства в области клиринговой деятельности;
постоянный мониторинг изменений внутренних документов СПВБ;
анализ новых направлений и услуг СПВБ с точки зрения возможных регуляторных рисков.

17.2. Контролер осуществляет описание и анализ выявленных регуляторных рисков с точки зрения их возможного влияния на текущую деятельность СПВБ.

17.3. Контролер осуществляет качественную и, по возможности, количественную оценку выявленных регуляторных рисков, которая включает в себя определение вероятности реализации регуляторных рисков и возможные негативные последствия для деятельности СПВБ.

17.4. Контролер составляет отчеты о выявленных регуляторных рисках, которые содержат описание, анализ и оценку выявленных регуляторных рисков, а также предлагаемые меры, и представляет их на рассмотрение Правлению СПВБ и Управляющему СПВБ.

17.5. На заседании Правления СПВБ принимаются решения о включении (или не включении) выявленных регуляторных рисков в реестр регуляторных рисков, в план деятельности Контролера и об управлении ими.

17.6. Контролер осуществляет мониторинг регуляторного риска в соответствии с утвержденными планом деятельности Контролера и реестром регуляторных рисков.

17.7. Контролер ведет реестр рисков, в котором описывается содержание регуляторных рисков, приводится экспертная оценка данного риска, вероятности его возникновения и возможного убытка для деятельности СПВБ.

17.8. По каждому из существенных рисков оценивается вероятность тех или иных возможных последствий и их ожидаемое воздействие на деятельность СПВБ.

17.9. После первичной оценки выявленных рисков Правление СПВБ пересматривает выявленные риски в свете приоритетных задач и нужд СПВБ и управление ими. В результате риски могут переоцениваться.

18. Порядок и критерии признания событий и последствий таких событий регуляторного риска существенными

18.1. Контролер должен информировать Управляющего СПВБ о вероятных и (или) наступивших событиях регуляторного риска клиринговой деятельности, 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 клиринговой деятельности), в течение рабочего дня с момента обнаружения вероятности наступления и (или) наступления указанных событий.

18.2. Отнесение событий регуляторного риска к категории существенных осуществляется Правлением СПВБ на основе отчетов о выявленных регуляторных рисках, представленных Контролером.

18.3. Критериями для признания событий регуляторного риска существенными являются:

оценка регуляторного риска как вероятного, высоковероятного или ожидаемого в соответствии с Методикой оценки рисков СПВБ (далее – Методика оценки рисков) и/или

существенный, критический или катастрофический убыток при реализации события регуляторного риска в соответствии с Методикой оценки рисков.

18.4. Перечень видов существенных событий и последствий таких событий регуляторного риска клиринговой деятельности:

- угроза аннулирования лицензии;
- угроза приостановления операций;
- угроза штрафов;
- угроза убытков СПВБ;
- угроза убытков клиентов (контрагентов).

19. Порядок учета событий, связанных с регуляторным риском клиринговой деятельности

19.1. Для учета событий, связанных с регуляторным риском клиринговой деятельности, Контролер ведет Журнал событий регуляторного риска клиринговой деятельности СПВБ (далее - Журнал событий регуляторного риска).

19.2. Контролер вносит записи в Журнал событий регуляторного риска на основании отчетов об инцидентах регуляторного риска.

20. Порядок определения вероятности возникновения событий, связанных с регуляторным риском клиринговой деятельности, и количественной оценки возможных последствий, связанных с их возникновением

20.1. Контролер осуществляет сбор и анализ статистических данных, связанных с реализацией регуляторного риска клиринговой деятельности.

20.2. Контролер проводит необходимые консультации с экспертами с целью получения оценки вероятности возникновения событий, связанных с регуляторными рисками, а также количественной оценки возможных последствий, связанных с их возникновением.

21. План деятельности Контролера по управлению регуляторным риском клиринговой деятельности

21.1. С целью реализации мер по управлению регуляторным риском клиринговой деятельности Контролер разрабатывает План деятельности по управлению регуляторным риском клиринговой деятельности СПВБ (далее - План деятельности по управлению регуляторным риском), который содержит наименование и мероприятия по управлению риском, критерии успешности управления риском, ответственных сотрудников (подразделения) СПВБ и сроки проведения мероприятий.

21.2. Контролер разрабатывает План деятельности по управлению регуляторным риском на основе реестра выявленных регуляторных рисков.

21.3. План деятельности по управлению регуляторным риском рассматривается на заседании Правления и утверждается приказом Управляющего СПВБ.

21.4. План деятельности по управлению регуляторным риском пересматривается по необходимости, но не реже одного раза в год.

21.5. В случае выявления новых регуляторных рисков они рассматриваются на заседании Правления СПВБ и при необходимости в План деятельности по управлению регуляторным риском вносятся изменения.

22. Порядок и сроки подготовки и направления Управляющему СПВБ на рассмотрение отчетов

22.1. Контролер предоставляет Управляющему СПВБ в письменной форме отчет о выявленных существенных событиях регуляторного риска клиринговой деятельности, содержащий рекомендации о мерах, необходимых для недопущения и (или) предотвращения таких событий не позднее рабочего дня, следующего за днем выявления указанных событий.

22.2. Контролер предоставляет Управляющему СПВБ в письменной форме отчет о деятельности Контролера за квартал, по форме, приведенной в Приложении №2 к Правилам внутреннего контроля, содержащий сведения о регуляторном риске клиринговой деятельности, а также рекомендации по управлению регуляторным риском клиринговой деятельности, информацию о принятых мерах, направленных на снижение или отказ от регуляторного риска клиринговой деятельности, и о результатах мониторинга деятельности структурных подразделений (работников структурных подразделений) клиринговой организации, осуществляемого в рамках управления регуляторным риском клиринговой деятельности, не позднее 30 дней после окончания квартала.

22.3. Отчеты подготавливаются Контролером в письменной форме в 2 экземплярах.

22.4. 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.

22.5. 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.

23. Порядок информирования Управляющего СПВБ о вероятных и (или) наступивших существенных событиях регуляторного риска клиринговой деятельности

23.1. Контролер предоставляет в письменной форме информацию Управляющему СПВБ или лицу его замещающему, о вероятных и (или) наступивших существенных событиях регуляторного риска клиринговой деятельности, в течение рабочего дня с момента обнаружения вероятности наступления и (или) наступления указанных событий.

24. Порядок информирования Контролера о вероятных и (или) наступивших событиях регуляторного риска клиринговой деятельности

24.1. Работники структурных подразделений и должностные лица СПВБ должны предоставлять информацию Контролеру о вероятных и (или) наступивших событиях регуляторного риска клиринговой деятельности.

24.2. Контролер осуществляет анализ представленной информации на предмет выявления регуляторных рисков.

24.3. Контролер фиксирует в Журнале событий регуляторного риска наступившие события регуляторного риска клиринговой деятельности.

25. Порядок информирования Совета директоров СПВБ

25.1. Контролер предоставляет Совету директоров СПВБ информацию о регуляторных рисках клиринговой деятельности в письменной форме один раз в год не позднее 31 марта за предыдущий год.

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

26. Порядок пересмотра Правил внутреннего контроля

26.1. Контролер готовит заключение о соответствии (несоответствии) Правил внутреннего контроля требованиям законодательства Российской Федерации о клиринговой деятельности, учредительным и внутренним документам СПВБ.

26.2. В случае несоответствия Правил внутреннего контроля требованиям законодательства Российской Федерации о клиринговой деятельности, учредительным и внутренним документам СПВБ Контролер готовит рекомендации по изменению Правил внутреннего контроля.

26.3. Контролер представляет заключение и рекомендации по изменению Правил внутреннего контроля Управляющему СПВБ в письменной форме один раз в год не позднее 31 марта.

Приложение №1
к Правилам внутреннего контроля
Форма отчета Контролера по результатам проверок

Конфиденциально

Управляющий АО СПВБ
_____ Ф.И.О.
« ____ » _____ 20__ г.

Отчет о деятельности Контролера
за период с _____ по _____ 20__ года

1. Виды деятельности, осуществляемые АО СПВБ на финансовых рынках.

2. Сведения о нарушениях законодательства Российской Федерации об организованных торгах, о клиринге и клиринговой деятельности, о противодействии неправомерному использованию инсайдерской информации и манипулированию рынком, нормативных актов Банка России, нормативных правовых актов Российской Федерации.

3. Принятые меры по устранению выявленных нарушений. Рекомендации по предупреждению нарушений.

4. Сведения о выявленных фактах неправомерного использования инсайдерской и/или служебной информации работниками АО СПВБ.

5. Сведения о мерах по выявлению и предотвращению конфликта интересов, возникающих в процессе деятельности на финансовых рынках между АО СПВБ и клиентами АО СПВБ.

6. Сведения о результатах проверок деятельности по управлению рисками.

7. Сведения о результатах иных проверок и иная информация.

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 клиринговой деятельности АО СПВБ
за ____ квартал ____ года

№ п/п	Краткое описание риска	Наименование индикатора (контрольного параметра) риска	Ответственное подразделение (лицо)	Документы контроля риска	Периодичность контроля	Пороговое значение	Отчетный период	Значение индикатора за отчетный период
-------	------------------------	--	------------------------------------	--------------------------	------------------------	--------------------	-----------------	--

Контролер АО СПВБ

Ф.И.О.

« ____ » _____ 20__ г.





Прошито, пронумеровано
и скреплено печатью АО СПБВ

17 (сенадцать) _____ листа(ов) ;

Управляющий

_____ / С. Б. Еганов /

26.11.18

