

УТВЕРЖДЕНЫ
советом директоров
ПАО «СПБ Биржа»
(протокол № 6 /2024 от 01.10.2024)

**ПРАВИЛА
УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ ПО ОРГАНИЗАЦИИ ТОРГОВ**

Москва, 2024 г.

ОГЛАВЛЕНИЕ

1.	ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ.....	2
2.	СИСТЕМА УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ, СВЯЗАННЫМИ С ОСУЩЕСТВЛЕНИЕМ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ БИРЖИ.....	2
3.	ОСНОВНЫЕ РИСКИ, СВЯЗАННЫЕ С ОСУЩЕСТВЛЕНИЕМ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ БИРЖИ.....	8
4.	ПОРЯДОК И ПРОЦЕДУРЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ	9
5.	УПРАВЛЕНИЕ ОТДЕЛЬНЫМИ ВИДАМИ РИСКОВ	12
6.	ПОРЯДОК УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ, СВЯЗАННЫМИ С ОКАЗАНИЕМ ПОСТАВЩИКАМИ ВНЕШНИХ УСЛУГ В ТЕЧЕНИЕ ВСЕГО ПЕРИОДА ИХ ОКАЗАНИЯ В СЛУЧАЯХ ОКАЗАНИЯ УСЛУГ, СВЯЗАННЫХ С ОСУЩЕСТВЛЕНИЕМ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ ПО ПРОВЕДЕНИЮ ТОРГОВ, А ТАКЖЕ В СЛУЧАЕ ОТКАЗА ПОСТАВЩИКА УСЛУГ ОТ ИСПОЛНЕНИЯ СВОИХ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ	23
7.	МЕРЫ, ПРЕДПРИНИМАЕМЫЕ БИРЖЕЙ ДЛЯ ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ЗАЩИТЫ ИНФОРМАЦИИ О РИСКАХ БИРЖИ, А ТАКЖЕ ИНФОРМАЦИИ, ПРЕДОСТАВЛЯЕМОЙ БИРЖЕЙ ПОСТАВЩИКУ УСЛУГ	23
8.	ПОРЯДОК РАЗРАБОТКИ И УТВЕРЖДЕНИЯ ПЛАНА ОИИВД	24
9.	ПЕРЕЧЕНЬ ОБСТОЯТЕЛЬСТВ, НАСТУПЛЕНИЕ КОТОРЫХ МОЖЕТ ПРИВЕСТИ К ПРИОСТАНОВЛЕНИЮ ИЛИ ПРЕКРАЩЕНИЮ ОКАЗАНИЯ ЗНАЧИМЫХ УСЛУГ	25
10.	МЕРЫ, ПРИНИМАЕМЫЕ БИРЖЕЙ В ЧРЕЗВЫЧАЙНЫХ СИТУАЦИЯХ И НАПРАВЛЕННЫЕ НА ОБЕСПЕЧЕНИЕ НЕПРЕРЫВНОСТИ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ ПО ОРГАНИЗАЦИИ ТОРГОВ.....	26
11.	МЕРЫ ПО ОБЕСПЕЧЕНИЮ БЕСПЕРЕБОЙНОГО ФУНКЦИОНИРОВАНИЯ ПРОГРАММНО-ТЕХНИЧЕСКИХ СРЕДСТВ БИРЖИ, ИСПОЛЪЗУЕМЫХ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ ПО ОРГАНИЗАЦИИ ТОРГОВ.....	27
12.	ПЕРЕЧЕНЬ МЕР, НАПРАВЛЕННЫХ НА ФУНКЦИОНИРОВАНИЕ РЕЗЕРВНОГО КОМПЛЕКСА СРЕДСТВ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ, ФУНКЦИОНАЛЬНО ДУБЛИРУЮЩЕГО ОСНОВНОЙ КОМПЛЕКС СРЕДСТВ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ (ДАЛЕЕ – РЕЗЕРВНЫЙ ОФИС).....	28
13.	ПОРЯДОК РАСПРЕДЕЛЕНИЯ ОТВЕТСТВЕННОСТИ И ПОЛНОМОЧИЙ МЕЖДУ СТРУКТУРНЫМИ ПОДРАЗДЕЛЕНИЯМИ БИРЖИ И ИХ РАБОТНИКАМИ В СЛУЧАЕ СУЩЕСТВЕННЫХ СОБЫТИЙ ОПЕРАЦИОННОГО РИСКА И (ИЛИ) ВЫЯВЛЕНИЯ ЧРЕЗВЫЧАЙНЫХ СИТУАЦИЙ	28
14.	МЕРЫ, ПРИНИМАЕМЫЕ БИРЖЕЙ ПО ЗАЩИТЕ ИНФОРМАЦИИ И ДОКУМЕНТОВ, СВЯЗАННЫХ С ПРОВЕДЕНИЕМ ОРГАНИЗОВАННЫХ ТОРГОВ.....	29
15.	ПОРЯДОК ОЦЕНКИ ЭФФЕКТИВНОСТИ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ И ФОРМИРОВАНИЯ ОТЧЕТНОСТИ ПО РИСКАМ	30
16.	ПОРЯДОК И ПЕРИОДИЧНОСТЬ ПРОВЕДЕНИЯ СТРЕСС-ТЕСТИРОВАНИЯ ПРОГРАММНО-ТЕХНИЧЕСКИХ СРЕДСТВ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ, А ТАКЖЕ ТРЕБОВАНИЯ К СЦЕНАРИЯМ, ИСПОЛЪЗУЕМЫМ ДЛЯ СТРЕСС-ТЕСТРОВАНИЯ	32
17.	ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ	33
	ПРИЛОЖЕНИЕ КОНТРОЛЬНЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ ОПЕРАЦИОННОГО РИСКА БИРЖИ	34

1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1.1. Настоящие Правила управления рисками деятельности по организации торгов (далее - Правила) являются внутренним документом Публичного акционерного общества «СПБ Биржа» (далее - Биржа) и определяют комплекс мер, направленных на управление рисками и снижение рисков, возникающих в процессе осуществления Биржей деятельности по проведению организованных торгов, а также в случае совмещения деятельности по организации торгов с иными видами деятельности, формируют регулятивную основу для построения эффективно работающей системы управления рисками, соответствующей характеру и объему совершаемых операций.

1.2. Правила разработаны на основании следующих требований:

- Федерального закона от 21.11.2011 № 325-ФЗ «Об организованных торгах» (далее – Закон об организованных торгах);
- Указание Банка России от 07.05.2018 № 4791-У «О требованиях к организации организатором торговли системы управления рисками, связанными с организацией торгов, а также с осуществлением операций с собственным имуществом, и к документам организатора торговли, определяющим меры, направленные на снижение указанных рисков и предотвращение конфликта интересов»;
- Положение Банка России от 17.10.2014 № 437-П «О деятельности по проведению организованных торгов»;
- Положение Банка России от 15.11.2021 № 779-П «Об установлении обязательных для некредитных финансовых организаций требований к операционной надежности при осуществлении видов деятельности, предусмотренных частью первой статьи 76.1 Федерального закона от 10 июля 2002 года N 86-ФЗ "О Центральном банке Российской Федерации (Банке России)", в целях обеспечения непрерывности оказания финансовых услуг (за исключением банковских услуг)» (далее - Положение Банка России от 15 ноября 2021 года № 779-П);
- Методические рекомендации по обеспечению непрерывности деятельности некредитных финансовых организаций Банка России от 18.08.2016 № 28-МР.
 - других нормативных актов Банка России.

1.3. Под рисками Биржи понимается возможность (вероятность) понесения Биржей потерь вследствие наступления неблагоприятных событий, связанных с внутренними и (или) внешними факторами.

1.4. Биржа организует систему управления рисками в соответствии с настоящими Правилами.

1.5. Настоящие Правила устанавливают:

- принципы организации системы управления рисками, связанными с осуществлением деятельности Биржи;
- цели и задачи управления рисками, связанные с осуществлением деятельности организатора торговли, а также в случае совмещения деятельности по организации торгов с иными видами деятельности.

1.6. Настоящие Правила:

- определяют и классифицируют риски, присущие Бирже;
- определяют основные методологические принципы и подходы к идентификации, оценке, мониторингу и контролю рисков;
- устанавливают порядок и сроки информирования органов управления Биржи, Департамента управления рисками (далее – ДепУР) и структурных подразделений о рисках;
- определяют перечень мер, предпринимаемых Биржей для обеспечения конфиденциальности информации о рисках, в том числе конфиденциальности отчетов о рисках;
- устанавливают периодичность проведения стресс-тестирования, а также требования к сценариям, используемым для такого тестирования;
- определяют меры, направленные на управление нефинансовыми рисками;
- устанавливают порядок и сроки проведения проверок эффективности управления рисками.

1.7. Биржа обеспечивает поддержание Правил в актуальном состоянии посредством их регулярного (не реже одного раза в год) пересмотра, а также внесения в них изменений в случае необходимости.

2. СИСТЕМА УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ, СВЯЗАННЫМИ С ОСУЩЕСТВЛЕНИЕМ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ БИРЖИ

2.1. Принципы организации системы управления рисками.

2.1.1. Под системой управления рисками понимается совокупность методов и процедур, а также функций и полномочий органов управления, подразделений и должностных лиц Биржи, отвечающих за управление рисками.

2.1.2. Система управления рисками Биржи организуется в соответствии со следующими принципами:

○ **Соответствие характеру и масштабу бизнеса** - система управления рисками должна соответствовать масштабу и сложности текущего бизнеса, осуществляемого Биржей, и обеспечивать выполнение целей и задач, определяемых на перспективу развития. При внедрении различных элементов системы управления рисками следует исходить из сопоставления затрат на реализацию механизмов анализа, контроля и управления рисками с потенциальными результатами от этой реализации, а также с затратами на организацию и внедрение продуктов, услуг или сервисов, несущих оцениваемые риски. Издержки на управление риском не должны превышать потенциальных убытков от его реализации.

○ **Интегрированность в процессы** - система управления рисками является структурно интегрированной системой, элементы которой внедрены в бизнес-процессы Биржи как их неотъемлемая часть, и предполагает участие в управлении рисками всех работников и структурных подразделений;

○ **Полнота покрытия** - построение системы управления рисками обеспечивает включение в ее структуру всех бизнес-процессов, необходимые элементы системы управления рисками присутствуют во всех сферах деятельности Биржи, оценка рисков и создание необходимых процедур управления рисками осуществляется, в том числе и для всех новых процессов и продуктов на стадии их проектирования

○ **Осведомленность** – органы управления, руководители и работники структурных подразделений Биржи должны быть своевременно осведомлены о рисках, связанных с выполняемыми ими бизнес-процессами и с планируемыми к реализации новыми операциями и проектами, что предполагает предварительное проведение идентификации и оценки соответствующих рисков;

○ **Непрерывность и регулярность** – система управления рисками предполагает непрерывный контроль управления рисками и соответствия предпринимаемых мер воздействия на риски характеру и масштабу операций Биржи. система управления рисками обеспечивает регулярный мониторинг, оценку и анализ рисков, проведение мероприятий, направленных на контроль функциональности действующих правил и процедур, обеспечение их соответствия текущим условиям, пересмотр и актуализацию методик, регламентов, аналитического и технологического обеспечения;

○ **Информация и документирование** – все работники Биржи обязаны незамедлительно доводить до сведения своего непосредственного руководителя и подразделения, ответственного за управление рисками, информацию о возможных и совершенных нарушениях применимого законодательства, устава и внутренних документов Биржи, связанных с выполняемой деятельностью. Биржа осуществляет документальную фиксацию (регистрацию) событий риска и мер воздействия на них. Обеспечивается хранение информации, используемой для управления рисками, в течение не менее 10 лет. Все процедуры и процессы, предусмотренные системой управления рисками, документируются в форме порядков, инструкций, регламентов, приказов и распоряжений и в обязательном порядке утверждаются уполномоченными органами управления Биржи. Документы доводятся до сведения работников в установленном порядке.

○ **Адаптивность и совершенствование** - система управления рисками формируется с учетом необходимости ее непрерывного совершенствования, все используемые процедуры и мероприятия обязательно включают в себя элементы, позволяющие контролировать их эффективность и актуализировать согласно изменениям внешних факторов и/или изменениям в стратегии развития и принципах работы Биржи.

2.2. Цели и задачи управления рисками.

2.2.1. Целью функционирования системы управления рисками Биржи является ограничение и контроль принимаемых рисков по всем направлениям деятельности в соответствии с собственными стратегическими задачами и целями, обеспечение достаточности собственных средств на покрытие принимаемых рисков и обеспечение надежного функционирования бизнес-процессов Биржи, а также поддержания рисков Биржи на определенном уровне.

2.2.2. Система управления рисками включает в себя процессы и мероприятия по идентификации, анализу и оценке рисков, меры воздействия на риски, мониторингу и контролю за рисками Биржи, и направлена на снижение рисков осуществления деятельности по организации торгов, предотвращению и урегулированию конфликта интересов, возникающего у нее в связи с совмещением деятельности по организации торгов с иными видами деятельности.

2.2.3. Управление рисками осуществляется на основе системного, комплексного подхода, который предполагает решение следующих задач:

- систематизация и внедрение подходов к управлению рисками, принятых в мировой практике;
- внедрение на Бирже эффективной системы управления рисками, позволяющей поддерживать надежность деятельности по проведению организованных торгов, а также иных видов деятельности, в случае совмещения деятельности по организации торгов с иными видами деятельности, на определенном

уровне и минимизировать убытки от реализации рисков.

- выявление областей возникновения рисков путем определения направлений деятельности Биржи, которые подвергаются риску;
- идентификация рисков путем определения источников и видов выявленных рисков;
- анализ рисков, предусматривающий определение метода их измерения, определение вероятности наступления таких рисков и степени воздействия на деятельность Биржи;
- установление допустимого уровня рисков и совокупного допустимого уровня рисков Биржи (далее Ограничения рисков);
- проведение оценки рисков путем сопоставления их уровня с максимально допустимым уровнем риска, а также совокупным допустимым уровнем рисков, установленным Биржей, для определения метода воздействия на такой риск;
- воздействие на риск, предусматривающее, в том числе, принятие решения органами управления Биржи, направленного на отказ от риска, его снижение, принятие или увеличение;
- мониторинг, пересмотр и контроль рисков, проводимые путем оценки изменения рисков и анализа результата воздействия на них;
- установление контрольных показателей и ключевых индикаторов для оценки риска;
- обмен информацией о рисках Биржи между подразделениями Биржи, между подразделениями Биржи и органами управления Биржи;
- снижение рисков Биржи при совмещении различных видов деятельности;
- принятие органами управления Биржи стратегически важных решений, обладая полной информацией о рисках, в том числе о вероятности возникновения расходов (убытков) и (или) иных неблагоприятных последствиях в случае принятия того или иного решения.
- своевременное информирование органов управления Биржи о вероятности возникновения и степени влияния рисков события, которое повлечет за собой возникновение у Биржи расходов (убытков), об уровне реализовавшихся рисков, а также о рекомендациях по снижению таких рисков Биржи или их исключению.
- контроль исполнения принятых органами управления решений о мерах воздействия на риски, а также регулярного информирования органов управления Биржи об исполнении принятых решений.
- обеспечение условий для бесперебойного функционирования программно-технических средств Биржи, используемых для осуществления деятельности по организации торгов.

2.3. Структура органов управления и структурных подразделений, осуществляющих функции, связанные с управлением рисками, их полномочия и функции в рамках системы управления рисками.

2.3.1. Организационная структура, обеспечивающая функционирование системы управления рисками, и система полномочий при принятии решений, связанных с управлением и принятием риска, должна обеспечивать:

- непрерывный контроль процесса управления рисками;
- вовлеченность органов управления, исполнительных органов, бизнес-подразделений Биржи в процессы управления рисками;
- разделение функций, полномочий и ответственности, исключающие конфликт интересов при принятии риска и его контроле;
- выполнение мер, направленных на предотвращение случаев дублирования (частичного дублирования) полномочий при распределении ответственности между советом директоров, правлением и структурными подразделениями.

2.3.2. Организационная структура в целях управления рисками охватывает:

- совет директоров;
- правление;
- генеральный директор;
- Департамент управления рисками;
- Департамент внутреннего контроля (далее - ДВК);
- Департамент внутреннего аудита (далее – ДВА);
- Структурные подразделения (руководители и работники структурных подразделений).

2.3.3. Органы управления Биржи обязаны поддерживать корпоративную культуру и этические нормы, демонстрирующие всем работникам Биржи важность управления рисками и способствующие осознанию рисков. Корпоративная культура и этические ценности Биржи должны учитывать решающее значение своевременного и открытого обсуждения возникающих проблем. Все работники Биржи, исходя из

их полномочий и ответственности, должны быть вовлечены в деятельность по управлению рисками и рассматривать ее как часть своих функциональных обязанностей.

2.3.4. Управление рисками каждого вида предусматривает:

- распределение между советом директоров и исполнительными органами Биржи полномочий и функций в процессе управления рисками Биржи;
- применение структурными подразделениями Биржи методов и процедур контроля и (или) минимизации риска, поддержание риска на уровне, не угрожающем интересам участников торгов, контрагентов и устойчивости Биржи;
- представление в установленном порядке структурными подразделениями Биржи информации о рисковом (рисковых) событии (событиях) в ДепУР;
- систематический обмен информацией о рисках между подразделениями Биржи по вопросам управления рисками;
- оперативное устранение возникающих угроз/рисков;
- документальную фиксацию фактов возникновения рисков Биржи и воздействия на них, а также хранение информации, используемой для управления рисками, в течение не менее 5 (пяти) лет.

2.3.5. К компетенции совета директоров Биржи относится следующее:

- определение структуры корпоративного управления Биржи;
- определение принципов и подходов к организации системы управления рисками;
- утверждение документов, внесение изменений (в том числе утверждение в новой редакции), признание утратившими силу документов, определяющих правила организации системы управления рисками;
- утверждение, внесение изменений (в том числе утверждение в новой редакции), признание утратившими силу документа, определяющего меры, принимаемые Биржей для восстановления финансовой устойчивости;
- утверждение, внесение изменений (в том числе утверждение в новой редакции), признание утратившими силу документа, определяющего меры, принимаемые Биржей в чрезвычайных ситуациях и направленные на обеспечение непрерывности осуществления деятельности по проведению организованных торгов;
- установление контрольных показателей операционного риска в целом по Бирже;
- контроль за текущим состоянием уровня риска по каждому из рисков Биржи и совокупного уровня рисков Биржи, а также контроль соблюдения установленных Биржей допустимого уровня рисков и совокупного допустимого уровня рисков Биржи посредством рассмотрения регулярной отчетности;
- контроль за выполнением процессов и мероприятий по управлению рисками, предусмотренных Правилами, в том числе анализ информации и контроль за выполнением рекомендаций, предоставление которых предусмотрено п. 15 Правил, посредством рассмотрения ежеквартальных отчетов о состоянии рисков;
- анализ информации о достаточности капитала, финансовых ресурсов и резервов, предназначенных для управления рисками;
- контроль за деятельностью исполнительных органов Биржи по управлению рисками;
- контроль выполнения стратегии развития Биржи.

2.3.6. К компетенции исполнительных органов управления Биржи относится оперативное управление рисками, включая, в том числе, следующее:

- обеспечение эффективной организации системы управления рисками;
- утверждение внутренних документов, определяющих порядок и процедуры управления рискам Биржи;
- распределение полномочий и ответственности в сфере управления рисками между структурными подразделениями Биржи, управленческим персоналом, наделение их необходимыми ресурсами, установление порядка взаимодействия, обмена данными и предоставления отчетности;
- контроль за выполнением процессов и мероприятий по управлению рисками, предусмотренных Правилами, анализ информации и контроль за выполнением рекомендаций, полученных в соответствии с п.п. 15, 16.6 Правил, посредством рассмотрения отчетов о состоянии рисков, отчетов о результатах стресс-тестирования средств проведения торгов на рынке ценных бумаг;
- установление допустимого уровня и совокупного допустимого уровня по всем выявленным рискам Биржи;
- установление контрольных показателей операционного риска по направлениям деятельности Биржи и составляющим их бизнес-процессам;
- контроль за текущим состоянием уровня риска по каждому из рисков Биржи и совокупного уровня рисков Биржи, а также контроль соблюдения установленных Биржей Ограничений рисков;
- утверждение Плана мероприятий по снижению значимых рисков Биржи или их исключению в случае превышения допустимого уровня рисков.

2.3.7. В целях контроля и ограничения рисков в рамках осуществления инвестиционной деятельности Биржи организован Комитет по управлению активами и пассивами (КУАП), к компетенции которого относится:

- утверждение лимитов на объем финансовых инструментов, в которые инвестируются средства Биржи;
- утверждение состава финансовых инструментов, в которые возможно инвестировать средства Биржи;

2.3.8. Текущее управление рисками Биржи осуществляется ДепУР, а так же работниками Биржи в пределах своей компетенции. Руководителем ДепУР является директор ДепУР Биржи.

2.3.9. На должность директора ДепУР назначается штатный работник Биржи, соответствующий требованиям, установленным законодательством Российской Федерации.

2.3.10. Назначение на должность директора ДепУР допускается с учетом ограничений, установленных Законом об организованных торгах и принятыми в соответствии с ним нормативными актами.

2.3.11. ДепУР не вправе осуществлять функции, которые не связаны с управлением рисками и осуществлением Биржей внутреннего контроля, за исключением случаев, установленных настоящими Правилами.

2.3.12. При исполнении своих функциональных обязанностей ДепУР наделяется независимостью от других должностных лиц и структурных подразделений Биржи.

2.3.13. На ДепУР не могут быть возложены обязанности, исполнение которых может привести к возникновению конфликта интересов, а также директор ДепУР не должен осуществлять функции, связанные с совершением операций и заключением сделок Биржи.

2.3.14. Работники ДепУР могут входить в состав создаваемых Биржей комитетов и комиссий, не являющихся структурными подразделениями Биржи.

2.3.15. К компетенции ДепУР относится :

- проведение обучения (консультаций) работников Биржи по вопросам выявления, идентификации, оценки и снижения рисков;
 - разработка и внедрение внутренних документов, регламентирующих управление рисками;
 - анализ и прогнозирование состояния системы управления рисками, выявление критических (наиболее опасных) бизнес – процессов и источников рисков, оценка достаточности капитала, финансовых ресурсов и резервов, предназначенных для управления рисками;
 - идентификация и изучение возможных угроз и уязвимостей Биржи, планирование предупредительных мероприятий;
 - разработка методологии и инструментов управления рисками;
 - сбор и анализ внутренних и внешних данных, связанных с рисками Биржи, обнаружение точек концентрации рисков и определение причин их возникновения;
 - оценка рисков Биржи с учетом вероятности их наступления и влияния на деятельность по проведению организованных торгов;
 - расчет, обоснование и оформление контрольных показателей и ключевых индикаторов рисков;
 - мониторинг контрольных показателей и ключевых индикаторов рисков;
 - разработка рекомендаций органам управления, руководителям структурных подразделений Биржи, о мерах, которые необходимо предпринять для устранения того или иного риска Биржи;
 - осуществление контроля выполнения мер, направленных на минимизацию выявленных рисков Биржи;
 - предоставление информации о рисках Биржи органам управления Биржи посредством регулярной отчетности, указанной в п. 15 и п. 16.6 настоящих Правил;
 - доведение до работников Биржи информации, необходимой для снижения рисков Биржи;
 - участие в разработке документов, которые регламентируют осуществление деятельности организатора торговли;
 - в рамках своих полномочий - принятие мер, направленных на обеспечение конфиденциальности информации, полученной в процессе управления рисками Биржи, в рамках процесса сбора данных, анализа и хранения;
 - принятие иных мер, направленных на управление рисками, предусмотренных внутренними документами Биржи.
- 2.3.16. ДепУР обеспечивается ресурсами и полномочиями, необходимыми для выполнения своих функций, в том числе:
- доступом ко всем информационным системам (в режиме просмотра) и внутренним документам Биржи, способным оказывать влияние на риски Биржи;
 - правом требования от управленческого персонала и работников Биржи дополнительной информации (в том числе и в письменном виде) в связи с выполнением обязанностей по управлению рисками;
 - правом оперативного реагирования на текущую деятельность Биржи в порядке, предусмотренном

внутренними документами Биржи;

- правом на участие в совещаниях с участием совета директоров Биржи, посвященных обсуждению вопросов, связанных с рисками Биржи, с правом внесения вопросов для обсуждения, в работе внештатных органов по управлению рисками - рабочих группах, профильных комитетах и т.п.;

- правом директора ДепУР на непосредственное обсуждение вопросов рисков с генеральным директором Биржи.

2.3.17. Компетенция ДВК:

- осуществление функций, связанных с управлением регуляторным риском;
- осуществление контроля в части соблюдения внутренних документов по управлению рисками требованиям регулирующих органов, в том числе в части соответствия действий и операций, осуществляемых руководством и работниками Биржи, требованиям действующего законодательства, внутренних нормативных и распорядительных документов;

- участвует в рамках своей компетенции в согласовании внутренних документов.

2.3.18. Компетенция ДВА:

- оценка эффективности системы управления рисками и достаточностью капитала, в том числе проверку методов оценки рисков, включая актуализацию документов, в которых установлены методы оценки рисков;

- выполнение регулярных проверок по всем направлениям деятельности Биржи, согласно утвержденному плану проверок;

- информирование совета директоров обо всех выявленных случаях нарушений работниками законодательства, нормативных актов, внутренних положений, политик, распоряжений, процедур, связанных с функционированием системы управления рисками, установленных лимитов, о мерах, принятых руководителями проверяемых подразделений, по устранению допущенных нарушений и их результатах.

2.3.19. Все структурные подразделения Биржи в рамках своих полномочий обязаны учитывать аспекты управления рисками, координировать свою деятельность с ДепУР, взаимодействовать и обмениваться с ним информацией по вопросам, относящимся к сфере управления рисками. В целях эффективного функционирования системы управления рисками взаимодействие структурных подразделений Биржи и ДепУР осуществляется по инициативе любой из сторон в рабочем порядке. В случае необходимости вопросы, связанные с управлением рисками в деятельности структурного подразделения, могут выноситься на рассмотрение органов управления Биржи.

2.3.20. При осуществлении своих функций структурные подразделения обязаны соблюдать установленные правила, процедуры и технологии.

2.3.21. В отношении управления рисками наиболее важными является:

- соблюдение процедур по обеспечению непрерывности деятельности Биржи;
- соблюдение процедур по обеспечению операционной надежности;
- обеспечение мер по сохранению деловой репутации Биржи;
- соблюдение установленных лимитов и ограничений на проводимые операции;
- соблюдение установленных контрольных показателей риска;
- соблюдение требований к составу и структуре активов;
- осуществление контроля за структурой финансовых активов и финансовых обязательств;
- утверждение состава финансовых инструментов, в которые могут быть инвестированы временно свободные средства Биржи;

- выполнение требований законодательства о рынке ценных бумаг;

- мониторинг изменений в правовом регулировании рынка ценных бумаг на предмет возникновения неучтенных рисков;

- соблюдение установленного порядка доступа к информации и документам;

- распределение прав доступа к информационным ресурсам и обеспечение информационной безопасности;

- авторизация участников торгов и контрагентов;

- регистрация, подтверждение и документирование поручений участников торгов;

- своевременное и полное рассмотрение обращений, заявлений и жалоб участников торгов;

- своевременное и качественное составление отчетности о рисках;

- выявление и своевременное урегулирование внутренних конфликтов между работниками или между работниками и Биржей;

- информирование новых работников о корпоративной культуре Биржи, принятых этических нормах и принципах управления рисками;

- своевременное урегулирование претензий, предъявленных к Бирже (ее работникам).

2.4. Требования к организации текущего управления Биржей в связи с управлением рисками

2.4.1. Ответственность за организацию надлежащего корпоративного управления возлагается на органы управления Биржи. Структура корпоративного управления должна обеспечивать создание эффективной контрольной среды.

2.4.2. При формировании структуры корпоративного управления Биржи, внутренних правил и технологий с учетом сложившейся на Бирже корпоративной культуры, Биржа руководствуется следующими нормами:

- исключение дублирования (частичного дублирования) полномочий структурных подразделений Биржи, четкое разграничение должностных обязанностей, обеспечение их неуклонного исполнения, а также введение подотчетности на всех уровнях;

- исключение возможностей чрезмерного внешнего и внутреннего влияния причастных сторон на работников подразделений Биржи и принятие бизнес – решений, ограничение концентрации полномочий, соответствие объемов полномочий и ответственности структурных подразделений, органов управления Биржи, управленческого персонала и работников, внедрение формализованных коллегиальных процедур принятия бизнес - решений;

- исключение возможностей совмещения исполнительских и контрольных функций подразделениями, управленческим персоналом и работниками подразделений Биржи;

- контроль за технологическими элементами бизнес – процессов, контактами с участниками торгов и контрагентами в соответствии с уровнем возможных рисков, исключение возможностей бесконтрольного проведения операций и осуществления контактов, связанных с обменом любой информацией, имеющейся в распоряжении Биржи, не являющейся общедоступной и содержащей сведения о Бирже, участниках торгов, а также информацией об операциях участников торгов, которая ставит лиц, обладающих такой информацией в силу своего служебного положения, трудовых обязанностей или договора, заключенного с участником торгов, в преимущественное положение по сравнению с другими субъектами отношений (далее - Служебная информация);

- разделение обязанностей работников Биржи, фрагментация бизнес – процессов, процедур и технологий на отдельные элементы с тем, чтобы одно подразделение, лицо из числа управленческого персонала или работник не могли осуществлять (контролировать) их от начала до конца.

3. ОСНОВНЫЕ РИСКИ, СВЯЗАННЫЕ С ОСУЩЕСТВЛЕНИЕМ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ БИРЖИ

3.1. Биржа на постоянной основе осуществляет идентификацию рисков, возникающих в процессе деятельности по организации торгов, а также в случае совмещения деятельности по организации торгов с иными видами деятельности. Идентификация рисков предполагает всесторонний анализ внешних и внутренних условий функционирования Биржи на предмет наличия или возможности появления факторов рисков.

3.2. В рамках управления рисками возникновения последствий, влекущих за собой приостановление или прекращение оказания услуг по проведению организованных торгов в полном или неполном объеме, Биржа определяет следующие виды рисков:

3.3. **Операционный риск** – риск нарушения деятельности Биржи в результате несовершенства внутренних бизнес-процессов и (или) действий или бездействия работников Биржи, ошибок в функционировании программно-технических средств Биржи, а также в результате внешних событий и (или) действий или бездействия третьих лиц.

К операционным рискам относится, в том числе:

3.3.1. **Правовой риск** - риск возникновения расходов (убытков) вследствие неоднозначного толкования норм права, судебной практики, а также нарушений договорных обязательств, вследствие:

- несовершенства правовой системы (противоречивости законодательства, отсутствия правовых норм по регулированию отдельных вопросов, возникающих в процессе осуществления деятельности организатора торгов);

- нарушения Биржей и (или) его контрагентами условий заключенных договоров;

- допускаемых Биржей правовых ошибок при осуществлении своей деятельности, неверное составление документов, в том числе для рассмотрения в судах;

- нарушение применимого законодательства, а в отношениях с нерезидентами применимого законодательства других государств;

- нарушения контрагентами нормативных правовых актов, применимого законодательства.

3.4. **Риск потери деловой репутации** - риск возникновения расходов (убытков) Биржи в результате негативного восприятия Биржи со стороны контрагентов Биржи, участников торгов и их клиентов, акционеров Биржи, Банка России и иных лиц, которые могут негативно повлиять на способность Биржи поддерживать существующие и (или) устанавливать новые деловые отношения и поддерживать на постоянной основе доступ к источникам финансирования.

3.5. **Стратегический риск** – риск возникновения расходов (убытков) Биржи в результате принятия ошибочных решений в процессе управления Биржей, в том числе при разработке, утверждении и

исполнении документов, определяющих направления и перспективы развития Биржи, ненадлежащем исполнении принятых решений в процессе управления Биржей, неучете органами управления Биржи изменений внешних факторов, влияющих или способных повлиять на процесс управления Биржей. В составе Стратегического риска учитывается:

3.5.1. **Страновой риск** - риск возникновения убытков Биржи, связанных с невозможностью либо нежеланием иностранных контрагентов, либо контрагентов, имеющих активы на территории иностранного государства и контрагентов, несущих конечный риск на территории иностранного государства (т.е. если с резидентами иностранного государства связано формирование источников погашения обязательств контрагента) выполнять свои обязательства из-за экономических, политических, социальных изменений, либо вследствие того, что валюта денежного обязательства может быть недоступна контрагенту из-за особенностей локального и/или национального законодательства (независимо от финансового положения самого контрагента).

3.6. **Риск, связанный с совмещением различных видов деятельности** - риск возникновения расходов (убытков), связанный с возможностью возникновения конфликта интересов в результате совмещения Биржей различных видов деятельности.

3.7. **Рыночный риск** - риск возникновения расходов (убытков) вследствие неблагоприятного изменения рыночной стоимости финансовых инструментов или иных активов, в которые инвестированы средства Биржи.

3.8. **Кредитный риск** - риск возникновения у Биржи убытков вследствие неисполнения, несвоевременного либо неполного исполнения контрагентом финансовых обязательств перед Биржей в соответствии с условиями договора.

3.9. **Регуляторный риск** – риск возникновения расходов (убытков) и (или) иных неблагоприятных последствий в результате несоответствия деятельности, осуществляемой ей на основании лицензии Биржи, требованиям законодательства Российской Федерации, регулирующего деятельность Биржи, правилам организованных торгов, учредительным и иным документам Биржи, и (или) в результате применения мер в отношении Биржи со стороны Банка России.

Организация выявления, анализа, оценки, мониторинга и контроля регуляторного риска деятельности по организации торгов, а также управления им осуществляется ДВК Биржи.

4. ПОРЯДОК И ПРОЦЕДУРЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

4.1. Управление рисками предполагает осуществление совокупности последовательных действий и включает следующие действия в отношении рисков:

- выявление областей возникновения рисков;
- идентификация рисков;
- анализ и оценка рисков;
- определение способов воздействия на риски, в том числе способов устранения последствий реализации рисков, обеспечение своевременного воздействия на риски;
- мониторинг и пересмотр рисков;
- обеспечение операционной надежности при осуществлении деятельности по организации торговли;
- регистрация событий операционного риска в аналитической базе данных;
- анализ и оценка событий риска;
- контроль ключевых индикаторов рисков;
- выявление событий операционного риска, связанных с нарушением операционной надежности;
- контроль соблюдения контрольных показателей операционного риска;
- разработка мероприятий по минимизации рисков и контроль за их выполнением;
- формирование регулярной отчетности по рискам;
- организация обмена информацией между органами управления и структурными подразделениями Биржи по вопросам, связанным с выявлением областей возникновения рисков, идентификацией рисков, их анализом и оценкой, а также реализацией мер, направленных на снижение рисков и устранение последствий реализации рисков;
- оценка эффективности управления рисками и соответствия предпринимаемых мер по управлению рисками характеру и масштабу деятельности Биржи;
- обучение (консультации) работников по вопросам, связанным с выявлением областей возникновения рисков, идентификацией рисков, их анализом и оценкой, а также реализацией мер, направленных на снижение рисков и устранение последствий реализации рисков.

4.2. **Основополагающие (базовые) процедуры по управлению рисками:**

- выявление (идентификация) рисков;
- анализ и оценка рисков;
- мониторинг, контроль и снижение рисков или их исключение;

- реагирование на риски;
- обмен информацией о рисках, информационное взаимодействие;
- восстановление технологических процессов, в случае их нарушения в результате реализации событий операционного риска, связанных с нарушением операционной надежности.

4.3. Выявление (идентификация) рисков.

4.3.1. Выявление (идентификация) риска представляет собой процесс обнаружения, описания и документирования риска.

4.3.2. Источником информации для выявления рисков могут являться:

- информация (отчеты) владельцев рисков;
- информация (отчеты) владельцев бизнес-процессов;
- результаты аудита (внутреннего и внешнего);
- результаты самооценки (анкетирования);
- предписания Банка России о факте нарушения;
- иные события.

4.3.3. Информация о выявленных видах риска вносится в Реестр рисков, который ведется работником ДепУР в электронном виде.

4.3.4. Информация о выявленных событиях операционного риска вносится в Базу событий операционного риска.

4.4. Анализ и оценка рисков, определение метода воздействия на риски

4.4.1. Анализ риска представляет собой процесс определения источников и видов выявленных рисков.

4.4.2. Определение источников риска начинается с изучения всех факторов, которые стали стимулом к появлению риска и которые могут повлиять на реализацию риска.

4.4.3. Анализ рисков, предусматривает определение метода их измерения по количественным и качественным критериям оценки рисков.

4.4.4. В целях оценки риска применяются следующие методы:

- метод прямой оценки;
- оценку по ключевым индикаторам;
- метод экспертной оценки;
- стресс-тестирование.

4.4.5. В общем случае анализ рисков и оценка уровня риска происходит исходя из вероятности их наступления и возможных финансовых последствий для деятельности Биржи.

4.4.6. Оценка риска производится посредством сравнения результатов анализа риска с установленными оценочными критериями риска (вероятности наступления, степени влияния, существенности последствий) для определения его уровня.

4.4.7. Текущая оценка рисков сопоставляется с установленными ограничениями рисков. В случае превышения допустимого уровня рисков, Биржа признает такие риски (за исключением операционного риска) значимыми.

4.4.8. В отношении рисков, признанных Биржей значимыми, ДепУР разрабатывает План мероприятий по снижению значимых рисков Биржи или их исключению (далее – План мероприятий). План мероприятий подлежит утверждению генеральным директором Биржи. План мероприятий подлежит пересмотру в случае выявления новых значимых рисков, или дополнительных фактов, которые требуют разработки и осуществления мероприятий по устранению выявленных нарушений Ограничения рисков и (или) иных мероприятий в отношении рисков Биржи в рамках снижения рисков Биржи или их исключения.

4.4.9. Информация об исполнении Плана мероприятий доводится до сведения органов управления Биржи путем включения информации о статусе исполнения в регулярную отчетность.

4.5. Мониторинг и контроль рисков.

4.5.1. Мониторинг представляет собой комплекс мероприятий и процедур, направленных на периодический сбор и анализ информации об изменении уровня риска. Мониторинг осуществляется с целью отслеживания изменений уровня риска, исследования причин данных изменений, а также для своевременного принятия действий, направленных на снижение уровня риска до приемлемого.

4.5.2. Мониторинг уровня риска производится на основании сбора и анализа информации о фактах возникновения / изменения уровня рисков Биржи.

4.5.3. Мониторинг уровня операционного риска производится, в том числе на основании сбора и анализа информации о фактах реализации событий операционного риска Биржи, зафиксированных в Базе событий операционного риска.

4.5.4. Мониторинг рисков представляет собой процесс отслеживания и контроля изменения количественных и качественных показателей на основе процедур:

- сбор и фиксация информации обо всех риск-событиях;
- сбор информации обо всех текущих нарушениях нормальной работы Биржи;
- сбор информации о количественных и качественных значениях установленных индикаторов риска;

- сбор и фиксация информации о событиях операционного риска, связанных с нарушением операционной надежности;
- сбор информации о контрольных показателях операционного риска;
- сбор информации о ключевых индикаторах операционного риска;
- сбор информации о выполнении мер реагирования, разработанных в целях минимизации риска;
- сбор информации о значениях целевых показателей операционной надежности;
- определение уровня рисков, сопоставление фактического уровня риска с максимально допустимым уровнем, выявление нарушений ограничений рисков;
- анализ результатов тестирования программно-технических средств Биржи;
- подготовка совокупной информации о системе управления рисками для включения в регулярную отчетность.

4.5.5. Для осуществления мониторинга отдельных видов рисков Биржей применяются индикаторы риска, являющиеся количественными и/или качественными показателями деятельности Биржи, посредством которых осуществляется измерение уровня риска, путем сопоставления с установленными пороговыми значениями для этих показателей.

4.5.6. В целях контроля за рисками Биржа устанавливает ограничения рисков и проводит мониторинг соответствия фактического уровня рисков установленным ограничениям рисков. Биржа на регулярной основе формирует отчетность, информирующую о состоянии системы управления рисками, представляемую органам управления с периодичностью и в сроки, предусмотренные настоящими Правилами, отражающую информацию о текущем состоянии рисков.

4.5.7. Биржа определяет максимально допустимый уровень для каждого риска Биржи и совокупного допустимого уровня риска Биржи (ограничение риска) в соответствии с количественными и качественными критериям, установленными в соответствии с внутренними документами по оценке рисков.

4.5.8. В случае выявления нарушений установленных ограничений рисков ДепУР осуществляет анализ и оценку причин возникновения нарушения и возможные последствия.

4.5.9. В случае выявления нарушений установленных ограничений рисков ДепУР проводит анализ факторов возникновения нарушений и по результатам анализа причин и последствий инициирует разработку планов и мероприятий по снижению негативных последствий, а также по снижению уровня риска или исключению риска, или пересмотру установленных ограничений. Определяются работники структурных подразделений, в сфере деятельности которых происходит увеличение уровня риска и осуществляется контроль развития негативных последствий.

4.5.10. При наличии плана ДепУР осуществляет контроль выполнения мер, предусмотренных планом мероприятий.

4.5.11. Полученная в процессе мониторинга уровня риска информация об изменении уровня риска включается в регулярную отчетность о рисках.

4.5.12. В целях обеспечения документальной фиксации информации о рисках и результатах ее оценки Биржа ведет Реестр рисков Биржи (далее - Реестр рисков).

4.5.13. Биржа поддерживает Реестр рисков в актуальном состоянии. ДепУР ежеквартально осуществляет оценку и анализ рисков с учетом вероятности их реализации, величины возможного убытка, влияния на процессы, процедуры и другие виды риска, оценивает достаточность применяемых контрольных процедур и мер реагирования на риск. По результатам ежеквартальной оценки ДепУР осуществляет пересмотр/актуализацию Реестра рисков Биржи.

4.6. Способы управления рисками (реагирование на риски)

4.6.1. Исключение рисков (отказ от рисков).

• риски могут быть исключены путем отказа от определенных видов деятельности и/или бизнес-процессов, несущих риски, которые не отвечают стратегическим целям.

4.6.2. Ограничение (снижение) рисков.

• риски могут быть уменьшены путем определения ограничений на размер принимаемого риска, включая лимиты на объем проведения определенных операций или размер взятых обязательств.

• риски могут быть уменьшены путем введения ограничений на риски, в том числе ограничения на проведение определенных операций или размер взятых обязательств, ограничение операций для различных групп контрагентов, а также путем применения современных видов контроля и организации деятельности, обеспечивающих минимальные уровни определенных видов рисков или полное отсутствие таких рисков.

4.6.3. Перераспределение (передача, страхование) рисков.

• риски могут быть уменьшены путем перераспределения рисков между различными контрагентами, а также путем страхования и/или хеджирования рисков.

4.6.4. Принятие рисков.

• риски, уровень которых не превышает установленный допустимый уровень, и для которых не предпринимаются действия для снижения их уровня, принимаются.

4.7. Обмен информацией о рисках, информационное взаимодействие

4.7.1. Работники Биржи обязаны незамедлительно, не позднее одного рабочего дня, доводить до сведения своего непосредственного руководителя и ДепУР, информацию о выявленном ими риске и/или о реализации риска, в том числе данные по событиям операционного риска, связанным с нарушениями операционной надежности, и по убыткам от реализованных событий рисков.

4.7.2. Информационное взаимодействие между структурными подразделениями, работниками и ДепУР осуществляется способами, обеспечивающими оперативность передачи информации, в т.ч. устно, путем направления сообщений по корпоративной электронной почте, составления служебных записок и прочие формы доведения информации.

4.7.3. Информирование органов управления о рисках Биржи производится посредством направления регулярной отчетности в соответствии с установленным порядком.

5. УПРАВЛЕНИЕ ОТДЕЛЬНЫМИ ВИДАМИ РИСКОВ

5.1. Операционный риск.

5.1.1. В целях управления операционным риском Биржи сформирована система управления операционным риском.

Система управления операционным риском включает следующие составляющие элементы:

- внутренние документы, регламентирующие правила и порядок управления операционным риском, процесс оценки эффективности системы управления операционным риском,
- организационную структуру задействованную при управлении операционным риском;
- классификация событий операционного риска, применяемая для фиксации событий операционного риска;
- базу событий операционного риска;
- контрольные показатели операционного риска;
- ключевые индикаторы операционного риска;
- перечень процессов Биржи, отнесенных к направлениям деятельности организатора торгов;
- комплекс мероприятий, направленных на снижение и уменьшение негативного влияния операционного риска;
- отчетность (информация для включения в отчет) по операционному риску;
- информационную систему, обеспечивающую порядок взаимодействия и обмена информацией участников управления операционным риском;

5.1.2. Биржа сформировала организационную структуру, обеспечивающую порядок распределения ответственности и полномочий в рамках управления операционным риском между советом директоров, правлением, генеральным директором, а также структурными подразделениями Биржи.

5.1.3. Управление рисками осуществляется на всех уровнях Биржи и подразумевает вовлечение всех органов управления и работников, полномочия и функции которых разграничены. Обязанности и ответственность за принятие и реализацию (выполнение) решений в области управления рисками между участниками системы управления операционным риском распределены таким образом, что исключено дублирование функций, но при этом обеспечивается согласованность и эффективность реализуемых мер по управлению операционным риском.

5.1.4. Система полномочий и участие органов управления и структурных подразделений в управлении операционным риском:

Совет директоров

- утверждение Правил организации системы управления рисками;
- утверждение Плана обеспечения непрерывности и восстановления деятельности в случае возникновения нестандартных и чрезвычайных ситуаций (План ОНиВД);
- утверждение Плана восстановления финансовой устойчивости Биржи;
- утверждение сигнальных и контрольных значений контрольных показателей операционного риска на годовой период в целом по Бирже;
- обеспечение мер реагирования в случае превышения контрольных значений контрольных показателей операционного риска;
- рассмотрение информации об операционном риске (в составе регулярной отчетности по рискам);
- рассмотрение отчета Департамента внутреннего аудита по результатам проверки эффективности системы управления рисками и процедур управления рисками согласно утвержденному плану работы Департамента внутреннего аудита;
- иные функции в области управления рисками, предусмотренные Уставом Биржи;

Департамент внутреннего аудита

- проверка эффективности методологии оценки операционного риска и процедур управления операционным риском, в рамках осуществляемых Департаментом внутреннего аудита проверок согласно утвержденному плану работы Департамента внутреннего аудита.

Правление

- принятие решений по вопросам, касающимся управления рисками, присущими деятельности Биржи (включая операционный риск), в том числе о минимизации или принятии рисков, не относящимися к компетенции совета директоров;
- рассмотрение информации об управлении операционным риском;
- иные функции, предусмотренные Уставом Биржи.

Генеральный директор

- обеспечение внедрения и применения Биржей принципов, процессов и систем управления рисками (включая операционный), присущими деятельности Биржи,
- рассмотрение и утверждение внутренних документов в части управления рисками, не отнесенные к компетенции иных органов управления, и изменений к ним, в том числе, определяющих порядок и процедуры управления операционным риском;
- утверждение целевых показателей операционной надежности Биржи и ключевых индикаторов операционного риска, используемых для мониторинга состояния операционного риска;
- обеспечение эффективного функционирования системы управления рисками в целом по Бирже, в том числе обеспечение эффективности системы управления операционным риском;
- утверждение значений контрольных показателей операционного риска на основе установленных значений контрольных показателей в целом по Бирже путем их распределения по направлениям деятельности и составляющих их бизнес-процессов;
- утверждение ключевых индикаторов операционного риска;
- обеспечение контроля за соблюдением требований к операционной надежности;
- обеспечение контроля за фактическими значениями контрольных показателей операционного риска и мерами реагирования в случае превышения сигнальных значений контрольных показателей операционного риска;
- контроль за деятельностью подразделений, участвующих в управлении операционным риском;
- принятие мер по минимизации риска в рамках своих полномочий,
- распределение полномочий и ответственности по управлению операционным риском между руководителями подразделений различных уровней, обеспечение их необходимыми ресурсами, установление порядка взаимодействия и представления отчетности.

Департамент внутреннего контроля

- осуществление на постоянной основе мониторинга изменений действующего законодательства об организованных торгах. В случае выявления изменений, которые могут повлиять в том числе на управление операционным риском, доведение данной информации до заинтересованных подразделений;
- осуществление контроля в процессе разработки Биржей внутренних нормативных документов, связанных с осуществлением деятельности по проведению организованных торгов (внесении изменений во внутренние документы, связанные с осуществлением деятельности по проведению организованных торгов), в целях выявления регуляторного риска деятельности по организации торгов.

Департамент управления рисками -

- разработка внутренних документов в области управления операционным риском;
- разработка и организация процедур по управлению операционным риском;
- участие в процедурах разработки новых продуктов/процессов/технологий, а также в процедурах внесения в них изменений с целью выявления и минимизации рисков в соответствии с регулирующими указанными процедурами внутренними регламентными документами Биржи,
- разработка и внесение изменений в систему показателей, используемых для оценки операционного риска;
- координация деятельности специализированных подразделений, связанной с управлением операционным риском;
- расчет, обоснование и оформление сигнальных и контрольных значений контрольных показателей операционного риска;
- осуществление мониторинга сигнальных и контрольных значений контрольных показателей операционного риска, оценка уровня операционного риска;
- участие в выборе способов реагирования на операционный риск;
- консультирование работников по вопросам управления операционным риском;
- осуществление идентификации (выявления), оценки и мониторинга операционного риска;
- контроль показателей, используемых для мониторинга операционного риска;
- регулярное составление и предоставление органам управления отчетности об уровне и состоянии рисков, в том числе операционного риска;

- контроль статуса выполнения мер, направленных на минимизацию операционного риска.

Юридический департамент подразделение, являющееся специализированным подразделением в отношении правового риска:

- разработка внутренних юридических документов, участие в согласовании внутренних документов Биржи;
- сбор и регистрация событий правового риска, информации о внутренних событиях правового риска и потерях от его реализации;
- выбор и применение способа реагирования на правовой риск;
- идентификация, сбор информации о правовом риске, как в собственном подразделении, так и в прочих структурных подразделениях Биржи;
- осуществляет стоимостную оценку реализовавшихся или возможных последствий правового риска в рамках выявленных инцидентов как в процессе осуществления деятельности собственного подразделения, так в отношении инцидентов выявленных прочими структурными подразделениями;
- информирует ДепУР о фактах реализации и потерях правового риска (штрафы, пени, неустойки и компенсации, судебные издержки и т.д.).

Департамент информационной безопасности подразделение, являющееся специализированным подразделением в отношении риска информационной безопасности:

- осуществляет разработку и поддерживает в актуальном состоянии внутренние нормативные документы Биржи по управлению риском информационной безопасности, разрабатывает методы/индикаторы выявления, оценки и мониторинга данного вида риска;
- выполняет процедуры управления операционным риском в части идентификации, сбора и регистрации информации о событиях риска информационной безопасности и потерях, выявление и регистрация инцидентов операционной надежности в базе событий операционного риска, мониторинга риска информационной безопасности, в том числе на основе информации, предоставляемой структурными подразделениями, ответственными за сбор информации о событиях операционного риска;
- осуществляет управление рисками информационной безопасности в соответствии с внутренними документами, регламентирующими управление и оценку рисков в области информационной безопасности;
- в рамках управления риском информационной безопасности осуществляет управление риском нарушения непрерывности деятельности;
- осуществляет взаимодействие с ДепУР по вопросам управления операционным риском;
- осуществляет разработку и проведение мероприятий, направленных на уменьшение негативного влияния риска информационной безопасности;
- информирует работников Биржи по вопросам, связанным с управлением риском информационной безопасности;

Департамент информационных технологий подразделение, являющееся специализированным подразделением в отношении риска информационных технологий:

- разрабатывает методы выявления и мониторинга рисков информационных систем в рамках компетенций своего подразделения;
- осуществляет сбор и регистрацию операционного риска, информации о внутренних событиях риска информационных систем и потерях от его реализации, в том числе на основе информации, предоставляемой структурными подразделениями;

Технический Департамент подразделение, являющееся специализированным подразделением в отношении риска ИТ-инфраструктуры:

- разрабатывает внутренние документы, связанные с риском ИТ-инфраструктуры;
- осуществляет сбор и регистрацию операционного риска, информации о внутренних событиях риска ИТ-инфраструктуры и потерях от его реализации, в том числе на основе информации, предоставляемой структурными подразделениями;
- определяет способ реагирования на риск ИТ-инфраструктуры;
- осуществляет мониторинг риска ИТ-инфраструктуры;
- организует функционирование резервного комплекса программно-технических средств, обеспечивающих надлежащее и бесперебойное осуществление деятельности Биржи как организатора торговли в случае невозможности осуществления деятельности центрального контрагента основным комплексом программно-технических средств в условиях возникновения нестандартных и чрезвычайных ситуаций;

- осуществляет разработку и проведение мероприятий, направленных на уменьшение негативного влияния риска ИТ-инфраструктуры;
- информирует ДепУР как о фактах реализации риска ИТ-инфраструктуры, так и о прочих факторах ;

Все структурные подразделения (владельцы бизнес-процессов)

- выявляют инциденты, произошедшие в процессах Биржи, в реализации которых участвует подразделение, и информируют ДепУР в порядке, установленном внутренними регламентными документами;
- осуществляют мониторинг и контроль уровня операционного риска в процессах, владельцем которых является подразделение;
- принятие мер по минимизации риска в рамках своих полномочий;
- разрабатывают (самостоятельно или совместно с ДепУР) и реализуют мероприятия по снижению уровня операционного риска, выявленных в процессах, владельцем которых является подразделение, либо инициируют вынесение сформированных предложений на рассмотрение единоличного исполнительного органа и/или коллегиальных органов управления Биржи в случае невозможности принятия соответствующих решений самостоятельно

Полномочия руководителей структурных подразделений

- участвуют в проведении самооценки уровня операционного риска в своем подразделении.
- осуществляют контроль за соблюдением внутренних процедур и порядков;
- осуществляют контроль за соблюдением установленных лимитов по проводимым операциям;
- информируют по мере выявления ДепУР о событиях операционного риска, которые могут привести к возникновению операционных потерь.
- участвуют в разработке совместно с ДепУР и реализации конкретных процедур контроля и мероприятий по минимизации выявленных операционных рисков.
- Руководители подразделений несут ответственность за реализацию системы управления операционным риском в своих подразделениях.

5.1.5. Общий порядок выявления областей возникновения рисков, их идентификации, анализа, оценки и мониторинга, применяемый, в том числе для операционного риска, содержится в п. 4 настоящих Правил. Особенности выявления областей возникновения операционного риска, его идентификации, анализа, оценки и мониторинга отражены в п. 5.1 настоящих Правил.

5.1.6. Операционный риск возникает в результате:

- не оптимально выстроенных, недостаточных и/или неэффективных контрольных процедур в системах и процессах;
- неадекватных действий работников (в том числе ошибок, внутреннего мошенничества);
- несовершенства организационной структуры и внутренних документов в части распределения полномочий подразделений и работников, порядков и процедур совершения операций, их документирования и отражения в учете;
- несоблюдения работниками установленных порядков и процедур;
- неэффективности внутреннего контроля;
- сбоя в функционировании систем и оборудования;
- нарушений информационной безопасности;
- неблагоприятных внешних обстоятельств, находящихся вне контроля компании (включая внешнее мошенничество, техногенные и природные катастрофы).

5.1.7. Выявление операционного риска предполагает анализ всех условий функционирования Биржи на предмет наличия или возможности возникновения факторов операционного риска, который проводится на нескольких уровнях:

- анализ изменений на финансовом рынке в целом;
- анализ подверженности операционному риску направлений деятельности Биржи;
- анализ внутренних процедур и бизнес-процессов;
- анализ внутренних структурных изменений;
- анализ отдельных операций;
- моделирование (сценарный анализ).

5.1.8. В целях выявления операционного риска проводится моделирование негативных сценариев реализации операционного риска, включающее в себя оценку источников возникновения событий операционного риска и их негативного влияния на деятельность Биржи в следствие их реализации, влекущие финансовые потери и / или негативное воздействие на деятельность. Одним из сценариев операционных рисков является нагрузочное тестирование, направленное на оценку устойчивости программно-технических средств, используемых для осуществления деятельности организации торговли, к

существенным изменениям, связанным с нарушением бизнес-процессов и внешним воздействием. По итогам моделирования составляется отчет.

5.1.9. Для управления операционным риском определены целевые показатели операционной надежности, обеспечивающие бесперебойность деятельности Биржи, а также конфиденциальность, целостность и сохранность данных, доступ к данным на постоянной основе.

5.1.10. Одним из механизмов выявления (идентификации) операционных рисков является процедура, направленная на выявление и оценку структурными подразделениями Биржи операционного риска, возникающего в деятельности структурного подразделения и (или) в деятельности Биржи как организатора торговли, путем определения вероятности реализации и негативного влияния от реализации операционного риска посредством регулярного проведения экспертной оценки работниками структурных подразделений Биржи своих процессов и видов деятельности с точки зрения потенциальной уязвимости по отношению к операционным рискам (далее – Самооценка). Целями Самооценки операционного риска являются:

- своевременное выявление угроз возникновения рисков в деятельности Биржи и предотвращение последствий возможных неблагоприятных событий;
- идентификация и оценка величины последствий и вероятности реализации существенных рисков Биржи;
- оценка бизнес-процессов, а также распределение полномочий и ответственности работников при исполнении своих должностных обязанностей в рамках этих бизнес-процессов;
- оценка эффективности существующих контрольных процедур.

5.1.11. Самооценка рисков проводится:

- по направлениям деятельности (направленная на оценку рисков, связанных с конкретным направлением деятельности, бизнес-процессом, продуктом, системой и т.д.);
- при значительном изменении бизнес-процессов;
- при выпуске новых продуктов;
- по поручению органов управления Биржи;
- не реже одного раза в год по инициативе ДепУР.

5.1.12. Результаты самооценки оформляются отчетом, итоги самооценки отражаются в регулярной отчетности и доводятся до сведения органов управления Биржи в установленном настоящими Правилами порядке.

5.1.13. В целях снижения операционного риска Биржей предусмотрены меры:

- определение перечня программно-технических средств, ошибки в функционировании которых влекут за собой нарушение критически важных процессов (критически важные программно-технические средства), включая программно-технические средства, с помощью которых обеспечивается проведение организованных торгов (средства проведения торгов), и не реже одного раза в год проведение анализа необходимости пересмотра перечня критически важных программно-технических средств. Перечень критически важных программно-технических средств и средств проведения торгов определяется в рамках пересмотра положений Плана ОНиВД;
- осуществление идентификации угроз, которые по оценке Биржи могут привести к неработоспособности критически важных программно-технических средств, а также постоянного мониторинга текущего состояния критически важных программно-технических средств, в том числе на предмет необходимости их обновления. Идентификация указанных угроз осуществляется специализированными подразделениями, обеспечивающими надлежащее функционирование критически важных программно-технических средств, в том числе средств проведения торгов;
- проведение испытательных работ в отношении критически важных программно-технических средств при их введении в эксплуатацию, в том числе при их обновлении, с учетом возможного изменения объемов проводимых операций, составление отчета по итогам проведенных испытательных работ и устранения недостатков, выявленных в работе критически важных программно-технических средств, по итогам проведенных испытательных работ

5.1.14. Для выявления (идентификации), мониторинга и оценки операционных рисков, а также с целью определения текущего состояния средств проведения торгов, в том числе на предмет необходимости их обновления, Биржа осуществляет регулярное проведение стресс-тестирования программно-технических средств Биржи (нагрузочное тестирование), используемых для осуществления деятельности по организации торгов.

5.1.15. С целью выявления угроз, которые по оценке Биржи могут привести к неработоспособности средств проведения торгов, Биржа проводит тестирование программно-технических средств, используемых для осуществления деятельности по проведению организованных торгов (тестирование отказоустойчивости).

5.1.16. Порядок и периодичность проведения нагрузочного тестирования и тестирования отказоустойчивости определены в п.16 настоящих Правил.

5.1.17. Перечень процессов, приостановление которых влечет за собой нарушение нормального осуществления деятельности Биржи, ее контрагентов и (или) участников торгов, в том числе создает угрозу

полной утраты их жизнеспособности (далее – Критически важные процессы, Значимые услуги) устанавливается в Плане обеспечения непрерывности и восстановления деятельности в случае возникновения нестандартных и чрезвычайных ситуаций (далее - План ОНВД).

5.1.18. К программно-техническим средствам Биржи, сбои и (или) ошибки в функционировании которых способны повлечь за собой приостановление или прекращение оказания Критически важных процессов в полном или неполном объеме и (или) оказать иное неблагоприятное воздействие на деятельность Биржи относятся следующие:

- SPB Platform - программа для ЭВМ, обеспечивающая возможность организации и проведения организованных торгов ценными бумагами;

- ИС Сайта в сети Интернет - сайт spbexchange.ru;

- ИС электронного документооборота;

5.1.19. В случае обнаружения недостатков в работе средств проведения торгов, выявленных в результате испытательных работ (тестирования) средств проведения торгов и (или) на основании полученной ДепУР информации от руководителей структурных подразделений Биржи о выявленных недостатках, а также в случае выявления несоответствия программно-технических средств характеру и объему совершаемых Биржей операций, ДепУР отражает выявленные недостатки в регулярной отчетности, предусмотренной Правилами, и при наличии включает рекомендации по устранению недостатков в работе средств проведения торгов, а также, в случае необходимости, рекомендации по улучшению (обновлению) программно-технических средств.

5.1.20. Биржа предоставляет право участнику торгов использования программного обеспечения, необходимого для участия в организованных торгах, участник торгов, в свою очередь, должен иметь техническую возможность участия в организованных торгах.

5.1.21. Биржа устанавливает требования к программно-техническим средствам, используемым участниками торгов и их клиентами при подключении к средствам проведения торгов, в том числе раскрывает указанные требования на сайте Биржи в сети Интернет.

5.1.22. Участники торгов вправе при организации подключения к средствам проведения торгов проводить консультации со специалистами Биржи, обеспечивающими техническую поддержку участников торгов Биржи.

5.1.23. Биржа предоставляет возможность участникам торгов/контрагентам в случае обнаружения ошибок/недостатков в работе программно-технических средств, связанных с их участием в организованных торгах, обратиться в Управление технической поддержки Биржи. Обращения участников торгов/контрагентов в Управление технической поддержки принимаются по электронной почте или по телефону, реквизиты которых указаны на сайте Биржи в сети Интернет. Работники, ответственные за взаимодействие с участниками торгов/контрагентами по вопросам организации технического доступа к торгам, проверяют информацию об обнаружении участниками торгов/контрагентами ошибок в работе программно-технических средств, и, в случае подтверждения ошибок, фиксируют обращения участников торгов/контрагентов и проводят работу по устранению выявленных недостатков с уведомлением заявителя об исполнении. Управление технической поддержки Биржи обязано довести информацию об обнаружении ошибок и недостатков в работе программно-технических средств до сведения ДепУР.

5.1.24. В целях обеспечения условий для эффективного мониторинга и контроля событий операционного риска, ДепУР осуществляет регистрацию событий операционного риска в Базе событий операционного риска (далее – База событий), в которой содержится информация обо всех выявленных событиях операционного риска, в том числе данные о расходах (убытках), понесенных Биржей вследствие реализации событий операционного риска. В Базу событий операционного риска включаются следующие сведения:

- фамилия, имя, отчество (при наличии), должность работника Биржи, внесшего запись о событии операционного риска в Базу событий;
- уникальный идентификационный номер события операционного риска, а также события операционного риска, связанного с выявленным событием операционного риска (в случае если данная связь установлена);
- дата и время регистрации события операционного риска в Базе событий;
- дата, когда произошло (началось) событие операционного риска (дата реализации);
- дата (и время в случае, если характер события операционного риска это предусматривает), когда Бирже стало известно о событии операционного риска (дата выявления);
- структурное подразделение, в котором произошло событие операционного риска (при наличии), а также структурное подразделение, выявившее событие операционного риска (при наличии);
- описание события операционного риска, а также его связи с другими видами рисков (при наличии);
- указание на то, что событие операционного риска является событием операционного риска, связанным с нарушением операционной надежности, регистрируемым в соответствии с пунктом 1.14 Положения Банка России от 15 ноября 2021 года № 779-П (при наличии);
- указание на то, что событие операционного риска является инцидентом защиты информации, регистрируемым в соответствии с пунктом 1.14 Положения Банка России от 20 апреля 2021 года № 757-П «Об установлении обязательных для некредитных финансовых организаций требований к

обеспечению защиты информации при осуществлении деятельности в сфере финансовых рынков в целях противодействия осуществлению незаконных финансовых операций» (при наличии);

- влияние события операционного риска на критически важные процессы (в случае если выявленное событие операционного риска влияет на критически важные процессы);
- указание на критически важные программно-технические средства, которые подверглись негативному воздействию события операционного риска или послужили причиной возникновения события операционного риска (в случае если критически важные программно-технические средства подверглись указанному негативному воздействию события операционного риска или послужили причиной возникновения события операционного риска);
- меры, направленные на устранение последствий реализации события операционного риска, а также на недопущение повторной реализации события операционного риска, которые были приняты в связи с выявлением события операционного риска;
- убытки вследствие реализации события операционного риска (при наличии).

5.1.25. В целях систематизации информации об операционном риске при внесении данных о событиях операционного риска в Базу событий применяется порядок классификации, который систематизирует все события операционного риска в разрезе следующих элементов:

- источников операционного риска,
- типов событий операционного риска,
- видов существенности и значимости событий операционного риска;
- направлений деятельности, в том числе в разрезе составляющих их бизнес-процессов;
- видов потерь от реализации операционного риска.

5.1.26. Источники операционного риска классифицируются в следующем порядке:
несовершенство внутренних бизнес-процессов Биржи;

- действия (бездействие) работников Биржи;
- ошибки в функционировании программно-технических средств Биржи;
- внешние события и (или) действия или бездействие третьих лиц.

5.1.27. Классификация событий операционного риска, применяемая для фиксации событий в Базе событий, определяется внутренними документами о порядке идентификации и регистрации событий в Базе событий операционного риска.

5.1.28. По виду существенности и значимости событий операционного риска классифицируются по следующим критериям;

существенные события операционного риска - событие, влекущее за собой приостановление осуществления критически важных процессов, а также иные события операционного риска, соответствующие критериям существенности события операционного риска, установленным решением Биржи;

значимые события операционного риска - событие, не относящееся к существенным событиям операционного риска, но оказывающее негативное влияние на осуществление критически важных процессов, а также иные события операционного риска, соответствующие критериям значимости события операционного риска, установленным решением Биржи;

- несущественное событие - событие, не являющееся существенным событием операционного риска или значимым событием операционного риска.

5.1.29. Направления деятельности Биржи в разрезе составляющих их бизнес-процессов определены внутренним документом о порядке проведения самооценки операционных рисков структурными подразделениями Биржи с учетом осуществляемой Биржей деятельности.

5.1.30. Потери от реализации операционного риска классифицируются в следующем порядке:

- прямые (финансовые) потери, отраженные в регистрах бухгалтерского учета;
- косвенные потери (качественные и потенциальные).

5.1.31. База событий операционного риска ведется в электронном формате. Сведения в Базу событий вносятся работниками ДепУР по мере выявления соответствующих событий и осуществления мероприятий по управлению операционным риском, связанным с возникновением таких событий, не позднее следующего рабочего дня с даты выявления события/получения необходимых сведений от структурных подразделений.

5.1.32. Биржа осуществляет контроль (аудит) основных процессов создания и эксплуатации автоматизированных систем, входящих в состав средств проведения торгов, 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.

5.1.33. Для контроля операционного риска Биржа определяет контрольные показатели операционного риска, позволяющие отслеживать их изменения, а также ключевые индикаторы операционного риска (количественные показатели), направленные на измерение и контроль операционного риска в определенный момент времени.

5.1.34. Биржа обеспечивает утверждение органом управления в соответствии с предусмотренными полномочиями:

- сигнальных значений контрольных показателей операционного риска и ключевых индикаторов операционного риска на плановый годовой период в разрезе бизнес-процессов в рамках деятельности Биржи как организатора торговли, при достижении которых проводится реализация мер, направленных на устранение превышения фактического значения показателя над установленным значением;
- контрольных значений контрольных показателей операционного риска и ключевых индикаторов операционного риска на плановый годовой период в разрезе процессов в рамках деятельности Биржи как организатора торговли, при нарушении которых информация доводится до совета директоров и правления Биржи.

5.1.35. Контрольные показатели операционного риска определены Приложением к Правилам.

5.1.36. ДепУР не реже 1 раза в три месяца проводит анализ контрольных показателей операционного риска и ключевых индикаторов операционного риска и при необходимости актуализирует их.

5.1.37. Информация о состоянии контрольных показателей и ключевых индикаторов операционного риска включается в регулярную отчетность о состоянии системы управления рисками Биржи.

5.1.38. В рамках управления операционным риском Биржа осуществляет меры по управлению рисками, связанными с оказанием поставщиками (третьими лицами) внешних услуг, которые возникают в связи с заключением Биржей договоров на получение внешних услуг.

5.1.39. Получение внешних услуг по заключенным Биржей договорам сопряжено со следующими рисками:

- получение услуги ненадлежащего качества;
- нарушение поставщиком условий договора, включая нарушение положений о конфиденциальности, предоставление поставщиком недостоверной информации.

5.1.40. Биржа осуществляет управление рисками, связанными с получением от поставщиков внешних услуг, что предполагает выполнение мер:

- в отношении поставщиков внешних услуг по заключенным с поставщиком договорам, обеспечивающих критически важные процессы, Биржа осуществляет оценку поставщика, включая анализ и оценку его финансового положения, надежность и деловую репутацию;
- заключение договоров на оказание услуг, обеспечивающих функционирование основного и резервного офисов, обеспечивается как минимум с двумя поставщиками телекоммуникационных услуг.

5.1.41. В целях снижения правового риска, управление которым осуществляется в рамках работы с операционным риском, осуществляются следующие меры:

- разрабатываются типовые формы договоров, нетиповые договоры согласовываются с Юридическим Департаментом;
- проводится правовая экспертиза внутренних документов;
- осуществляется постоянный мониторинг применяемого законодательства и судебной практики, связанной с деятельностью по проведению организованных торгов;
- осуществляются иные действия, предусмотренные внутренними документами, в рамках деятельности Юридического Департамента.

5.2. Риск потери деловой репутации.

5.2.1. Источниками возникновения риска потери деловой репутации могут являться следующие внешние и внутренние факторы:

- несоответствие Биржи требованиям законодательства Российской Федерации;
- несоблюдение обычаев делового оборота и принципов профессиональной этики;
- неисполнение договорных обязательств перед участниками торгов и контрагентами;
- неисполнение (ненадлежащее исполнение) работниками своих должностных обязанностей;
- мошеннические действия персонала – совершение работниками умышленных действий, направленных на получение личной выгоды и причинение ущерба участникам торгов и контрагентам Биржи;
- недостатки в управлении рисками Биржи, приводящие к возможности нанесения ущерба деловой репутации;
- опубликование негативной информации о Бирже или ее работниках, учредителях, членах органов управления, аффилированных лицах, дочерних и зависимых организациях в средствах массовой информации;
- попадание компаний группы СПБ Биржа под санкции США и Евросоюза.

5.2.2. Выявление (идентификация) риска потери деловой репутации предполагает, в том числе, использование внешних источников информации: периодических печатных изданий, радио, телевидение, иные формы распространения массовой информации, включая Интернет.

5.2.3. Структурным подразделением, осуществляющим мониторинг публикаций о Бирже во внешних источниках информации, является подразделение, в функционал которого входит осуществление связей со средствами массовой информации.

5.2.4. Полученные сведения о потенциальных фактах риска потери деловой репутации проверяются на достоверность и значимость.

5.2.5. Проверка на достоверность предполагает подтверждение сведений перекрестной информацией из другого источника.

5.2.6. Мониторинг риска потери деловой репутации осуществляется на постоянной основе, в том числе путем:

- регулярного изучения показателей деятельности Биржи;
- мониторинга количества жалоб и претензий к Бирже, в том числе относительно качества обслуживания участников торгов и контрагентов, соблюдения обычаев делового оборота;
- мониторинга позитивных и негативных отзывов и сообщений в СМИ о деятельности Биржи, а также об ее акционерах и аффилированных лицах, в том числе с использованием специализированных автоматизированных информационных систем.

5.2.7. Оценка фактов риска потери деловой репутации проводится экспертно исходя из того, насколько ущерб репутации Биржи усложнит достижение целей, которые ставит перед собой Биржа в своей деятельности.

5.2.8. Мероприятия по укреплению деловой репутации Биржи включают в себя в том числе:

- информирование заинтересованных лиц о деятельности Биржи, о достигнутых положительных результатах, о мерах, направленных на улучшение качества обслуживания участников торгов, о совершенствовании системы управления рисками, о положительных оценках Биржи участниками торгов и т.д.;

- реклама и мероприятия, направленные на укрепление деловой репутации.

5.3. Стратегический риск.

5.3.1. Источниками стратегического риска для Биржи могут являться:

- управленческие решения по организации, структуре и развитию бизнеса;
- процесс стратегического планирования;
- полное/частичное отсутствие необходимых ресурсов, в том числе финансовых, материально-технических и людских для достижения стратегических целей;
- изменение внешней среды деятельности Биржи.

5.3.2. Направления и перспективы развития Биржи определяются советом директоров. Управление стратегическим риском осуществляется исполнительными органами во взаимодействии с ДепУР.

5.3.3. Мониторинг и оценка стратегического риска осуществляется на постоянной основе посредством:

- регулярного изучения показателей деятельности Биржи;
- анализа сопоставимых показателей конкурентов;
- оценки влияния внешней среды на развитие деятельности Биржи в перспективе.

5.3.4. В рамках управления стратегическим риском ДепУР осуществляет управление проектами, включающее следующие мероприятия:

- участие в разработке проектов изменений в порядок осуществления деятельности по проведению организованных торгов или связанной с проведением организованных торгов деятельности, предоставления дополнительных услуг, допуска к организованным торгам новых финансовых инструментов, иностранной валюты, товара, а также иных организационных и (или) технологических изменений (далее – проекты изменений);

- проводит анализ целесообразности внедрения проектов изменений;
- проводит анализ ресурсов, необходимых для поддержания системы управления рисками на должном уровне;

- проводит анализ эффективности реализованных Биржей проектов изменений по итогам их введения в деятельность, осуществляемую Биржей;

- проводит оценку мероприятий по планированию развития деятельности Биржи, в том числе посредством участия в разработке стратегии развития Биржи на срок, соответствующий характеру осуществляемой деятельности Биржи и объему совершаемых операций;

- проводит оценку стратегии развития Биржи на предмет определения возможности и целесообразности ее реализации, а также внесение изменений в стратегию развития Биржи в случае принятия Биржей указанного решения.

5.3.5. Для обеспечения возможности осуществления мероприятий, предусмотренных в п. 5.3.4. настоящих Правил, органы управления и подразделения, ответственные за разработку и реализацию проектов, обеспечивают предоставление ДепУР информации о таких проектах и ходе их выполнения.

5.3.6. В рамках управления стратегическим риском ДепУР участвует в разработке проектов изменений в порядок осуществления деятельности по проведению организованных торгов или связанной с проведением организованных торгов деятельности, в том числе предоставления дополнительных услуг, допуска к организованным торгам новых финансовых инструментов, иностранной валюты, товара, а также

иных организационных и (или) технологических изменений посредством участия работников ДепУР в тематических рабочих совещаниях, в согласовании регламентирующих внутренних документов при внесении в них тематических изменений.

5.4. В связи с продолжающейся сложной геополитической ситуацией, которая оказывает значительное влияние на сферу деятельности Биржи и реализацию ее стратегических целей, в составе стратегического риска учитывается страновой риск.

5.4.1. Возникновение странового риска может быть обусловлено как внутренними, так и внешними причинами, которые не зависят от финансового положения контрагента Биржи. Страновой риск зависит от политико-экономической стабильности стран-контрагентов, стран-партнеров, стран-клиентов (участников торгов), участников финансового рынка, работающих с Биржей, во взаимодействии с которыми Биржа стремится достичь целей своей деятельности.

5.4.2. Источниками странового риска для Биржи являются:

- активы, финансовые инструменты, в иностранной валюте;
- контрагенты, являющиеся резидентами иностранных государств;
- активы, размещенные на территории иностранных государств;
- финансовые инструменты эмитентов иностранных государств;

5.4.3. Факторами странового риска являются:

- дестабилизация политической ситуации;
- расширение списка ограничительных мер в отношении России и их продолжительность;
- эскалация военных конфликтов в мире;
- макроэкономическая нестабильность;
- экспроприация/ограничение на неопределенный срок активов Биржи /участников торгов;
- неэффективность законодательной базы и судебной системы.

5.4.4. Под внешними причинами (внешняя среда) понимается совокупность внешних условий (экономических, правовых, рыночных, социокультурных, политических, природных, конкурентной сферы на международном, региональном или местном уровне, ключевые критерии тенденции, которые могут воздействовать на достижение установленных целей, взаимоотношения с внешними причастными сторонами, восприятие ими риска и значимость для Биржи этих причастных сторон, и других), в которых Биржа стремится достичь целей своей деятельности и выполнить свои функции.

5.4.5. Под внутренними причинами (внутренняя среда) понимается совокупность внутренних условий (политики, целей и задач, стратегий управления, организационной структуры, обязанностей и полномочий, процессов принятия решений, внутренних взаимосвязей, ИТ-систем и технологий, информационных потоков и пр.), направленных на обеспечение достижения Биржей целей своей деятельности и выполнения функций.

5.4.6. Страновой риск не выделяется как самостоятельный вид риска для управления, но учитывается при планировании проектов, либо принятии решений при совершении операций с иностранными контрагентами, с финансовыми инструментами эмитентов нерезидентов.

При реализации проектов, с присущим страновым риском Биржа применяет повышенные требования к уровню эффективности и оценке реализуемости таких проектов. В случае ухудшения политической или социально-экономической ситуации в сфере деятельности Биржи необходимо планировать комплекс антикризисных мер, среди которых: сокращение издержек, оптимизация инвестиционной программы, снижение доли в проекте и привлечение партнеров, понижающих влияние факторов странового риска.

5.5. Риск, связанный с совмещением деятельности по проведению организованных торгов с иными видами деятельности.

5.5.1. Биржа совмещает деятельность по организации торговли и репозитарную деятельность, а также может осуществлять деятельность оператора информационной системы и оператора обмена цифровых финансовых активов.

5.5.2. Успешная реализация Стратегии развития Биржи напрямую зависит от правильно выстроенного взаимодействия с участниками торгов (клиентами) и контрагентами. В этом взаимодействии Биржа придерживается принципа приоритета интересов клиента перед собственными интересами и интересами работников Биржи, строит отношения с клиентами на принципах равноправия клиентов, добросовестности и полноты раскрытия необходимой информации.

5.5.3. Для достижения своих стратегических целей в рамках системы мер по минимизации риска, связанного с совмещением деятельности по проведению организованных торгов с другими видами деятельности, Биржа использует следующие механизмы и методы:

- исключение возможностей совмещения исполнительских и контрольных функций подразделениями, управленческим персоналом и работниками подразделений Биржи;
- разделение служебных обязанностей работников структурных подразделений Биржи в соответствии с их должностными инструкциями;
- установление требований по обеспечению защиты Служебной информации от

несанкционированного доступа;

- обеспечение доступа к сведениям, составляющим Служебную информацию, только тем работникам Биржи, которым в соответствии со своими должностными обязанностями должен быть предоставлен в установленном порядке доступ к работе с такой информацией;

- в случае, если работникам Биржи предоставлен доступ к Служебной информации, Биржа осуществляет внутренние проверки деятельности таких работников;

- в случае, если работнику Биржи не требуется использование Служебной информации при исполнении своих должностных обязанностей, Биржа устанавливает ограничения прав доступа к такой информации;

- в случае, если должностные обязанности работника связаны с осуществлением операций в интересах Биржи, Биржа устанавливает ограничение прав доступа к Служебной информации этим работникам.

- установление дисциплинарных мер ответственности за предоставление работниками подразделений Биржи, осуществляющими деятельность по организации торгов или иные виды деятельности, Служебной информации работникам других подразделений, за исключением информации, необходимой для осуществления функциональных обязанностей; за неправомерное исполнение поручений других подразделений.

5.5.4. В целях снижения рисков, связанных с совмещением Биржей видов деятельности, созданы отдельные структурные подразделения для осуществления каждого из видов деятельности:

- для осуществления деятельности по организации торговли создано структурное подразделение, в исключительной функции которого относится организация и осуществление торговли;

- для осуществления репозитарной деятельности создано структурное подразделение, в исключительной функции которого относится репозитарная деятельность;

- деятельность оператора информационной системы и оператора обмена цифровых финансовых активов предполагает формирование структурного подразделения с осуществлением исключительно указанных функций;

- для осуществления каждого из видов деятельности используются независимые программно-технические средства.

5.5.5. Вместе с тем Биржей разработан документ, определяющий перечень мер, направленных на предотвращение конфликта интересов при проведении организованных торгов, включающий в себя меры по предотвращению и урегулированию конфликта интересов, при совмещении Биржей деятельности по проведению организованных торгов с иными видами деятельности.

5.5.6. При реализации мер по управлению рисками, связанными с совмещением Биржей видов деятельности принимаются меры, направленные на предотвращение случаев дублирования полномочий структурных подразделений Биржи. Департаменты внутреннего контроля, внутреннего аудита, управления рисками принимают участие в рассмотрении и согласовании внутренних документов Биржи, определяющих полномочия структурных подразделений, при их разработке или их пересмотре, с целью недопущения дублирования полномочий, связанных с управлением рисками совмещения деятельности, способных привести к конфликту интересов. При выявлении дублирования (частичного дублирования) полномочий структурных подразделений Биржа предпринимает действия, направленные на внесение изменений и дополнений в документы, определяющие их полномочия (функции).

5.6. Рыночный риск.

5.6.1. Рыночный риск возникает в результате наличия отрицательной переоценки рыночной стоимости финансовых инструментов или активов, в которые инвестированы средства Биржи.

5.6.2. В целях снижения рыночного риска Биржа:

- ограничивает список инструментов, в которые можно инвестировать средства Биржи;

- устанавливает лимиты на объем финансовых инструментов, в которые инвестируются средства Биржи;

- устанавливает перечень инструментов, в которые возможно инвестировать средства Биржи;

- на регулярной основе проводит мониторинг стоимости инвестиционного портфеля Биржи.

5.7. Кредитный риск

5.7.1. Источником кредитного риска является возможное неисполнение одним или несколькими контрагентами своих обязательств перед Биржей в процессе осуществления Биржей текущей и инвестиционной деятельности.

5.7.2. В целях ограничения кредитного риска Биржа:

- проводит предварительный комплексный анализ финансового положения контрагентов, в которых размещаются собственные средства Биржи;

- ограничивает список инструментов, в которые можно инвестировать средства Биржи;

- определяет перечень допустимых инструментов, в процессе осуществления Биржей инвестиционной деятельности;

- осуществляет регулярный мониторинг финансового положения контрагентов, в которых размещены средства Биржи.

6. ПОРЯДОК УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ, СВЯЗАННЫМИ С ОКАЗАНИЕМ ПОСТАВЩИКАМИ ВНЕШНИХ УСЛУГ В ТЕЧЕНИЕ ВСЕГО ПЕРИОДА ИХ ОКАЗАНИЯ В СЛУЧАЯХ ОКАЗАНИЯ УСЛУГ, СВЯЗАННЫХ С ОСУЩЕСТВЛЕНИЕМ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ ПО ПРОВЕДЕНИЮ ТОРГОВ, А ТАКЖЕ В СЛУЧАЕ ОТКАЗА ПОСТАВЩИКА УСЛУГ ОТ ИСПОЛНЕНИЯ СВОИХ ОБЯЗАТЕЛЬСТВ

6.1. В случае заключения Биржей договоров на оказание услуг, связанных с осуществлением деятельности по проведению организованных торгов (далее - внешние услуги), с третьим лицом (далее - поставщик услуг), такой договор должен обеспечивать наличие у Биржи информации и документов, необходимых и достаточных для эффективного управления рисками деятельности по организации торгов.

6.2. В целях полноценного функционирования системы управления рисками Биржи, договоры с поставщиками услуг при необходимости могут, в том числе, содержать положения, предусматривающие обязанность поставщика услуг:

- Реагировать в течение установленного времени на определенные обращения Биржи;
- Осуществлять мониторинг определенных показателей;
- Предоставлять Бирже регулярную и нерегулярную отчетность;
- Фиксировать на своей стороне инциденты операционного риска и предоставлять информацию о них Бирже в установленные сроки;
- Участвовать в технологических работах Биржи;
- Участвовать в тестированиях, проводимых Биржей.

6.3. К организациям, являющимся поставщиками внешних услуг, связанными с осуществлением деятельности по проведению торгов, в силу существующих положений заключенных договоров на оказание услуг, относятся:

Ассоциация «НП РТС» - организация, предоставляющая право использования оборудования (серверов), используемого для функционирования программного обеспечения для проведения организованных торгов ценными бумагами, а также оказывающая услуги по сопровождению (техническому обслуживанию) оборудования (серверов), используемого для функционирования указанного программного обеспечения, направленные на обеспечение их бесперебойной работы.

АО «СПБ Технологии» - организация, оказывающая услуги по сопровождению (техническому обслуживанию) программного обеспечения для проведения организованных торгов ценными бумагами, включающему в себя проведение регулярных профилактических работ, устранение неполадок и сбоев, возникших в работе, а также услуги по адаптации указанного программного обеспечения.

АО «Бест Экзеkjюшен» - организация, оказывающая услуги по предоставлению участникам торгов права использования программного обеспечения для участия в организованных торгах Биржи и услуги по определению параметров заявок в рамках сервиса «best execution».

6.4. В случае отказа поставщиков услуг от исполнения своих обязательств подразделение, осуществляющее управление сервисом, на который оказывает влияние отказ от исполнения обязательств поставщиком услуг, проводит анализ возможности и перевод исполнения сервиса на другого имеющегося контрагента, предлагающего аналогичный сервис и/или обеспечение сервиса силами работников Биржи.

6.5. В случае необходимости проводится экстренное заседание правления Биржи, при невозможности разрешения сложившейся ситуации на уровне исполнительных органов, информация доводится до сведения совета директоров Биржи для определения нового поставщика услуг, предлагающего аналогичный сервис.

6.6. В случае отсутствия альтернативного поставщика услуг либо недостаточности ресурсов для восстановления сервиса приоритет при восстановлении отдается Критически важным процессам.

6.7. В случае заключения Биржей договоров на оказание услуг, связанных с осуществлением деятельности по проведению организованных торгов с поставщиками услуг, система управления рисками принимает меры по предоставлению Бирже информации и документов, сформированных поставщиком услуг в связи с оказанием внешних услуг, а также обеспечивает управление рисками, связанными с оказанием поставщиком внешних услуг в течение всего периода их оказания.

6.8. Непрерывность осуществления критически важных процессов обеспечивается в соответствии с планом ОНиВД.

7. МЕРЫ, ПРЕДПРИНИМАЕМЫЕ БИРЖЕЙ ДЛЯ ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ЗАЩИТЫ ИНФОРМАЦИИ О РИСКАХ БИРЖИ, А ТАКЖЕ ИНФОРМАЦИИ, ПРЕДОСТАВЛЯЕМОЙ БИРЖЕЙ ПОСТАВЩИКУ УСЛУГ

7.1. Информация о рисках Биржи относится к Служебной информации и на нее в полной мере распространяется порядок защиты такой информации.

7.2. Для обеспечения конфиденциальности информации о рисках, в том числе конфиденциальности отчётов о рисках ДепУР устанавливается следующий порядок предоставления информации и отчетности по вопросам управления рисками работникам Биржи, совету директоров и органам управления Биржи:

- в ходе работ по идентификации, оценке, мониторингу, контролю рисков ДепУР информирует работников структурных подразделений Биржи о выявленных рисках, отнесённых к деятельности структурных подразделений, работниками которых они являются, в объёме необходимом для эффективного участия работников в оценке риска и формировании планов мероприятий по их снижению и/или контролю.

- если иное не определено во внутренних документах Биржи:

- сроки информирования работников структурных подразделений и предоставление отчетности структурным подразделениям Биржи о рисках определяются ДепУР на основе его профессионального суждения, формируемого с учётом оценки риска;
- сроки и форма предоставления информации работниками Биржи ДепУР определяется в соответствующем запросе ДепУР;
- органам управления Биржи ДепУР предоставляется полная и своевременная информация, в том числе отчётность по рискам, в соответствии со сроками и порядком, определённым в настоящих Правилах.

7.3. Для обеспечения конфиденциальности и защиты информации, предоставляемой Биржей поставщику услуг, Биржа обеспечивает выполнение требований по обеспечению безопасности объектов информационной инфраструктуры, в том числе предпринимает следующие меры:

Организационные меры:

- в договорах на оказание поставщиком услуг Бирже в обязательном порядке устанавливаются требования к обеспечению конфиденциальности информации, которые обязует соблюдать поставщик услуг;

- режимные мероприятия по ограничению доступа посторонних лиц в помещения Биржи, в том числе к средствам вычислительной техники, расположенным в них;

- на Бирже действуют специализированные системы охраны и видеоконтроля, позволяющие исключить несанкционированный доступ в помещения посторонних лиц;

- в технические помещения, где размещена вычислительная техника (серверное оборудование), допускаются только те работники Биржи, которым в соответствии с выполняемыми служебными обязанностями необходима работа с такой техникой (оборудованием).

Технические меры:

С целью защиты от несанкционированного доступа к Служебной информации при ее передаче по открытым каналам связи используются средства криптографической защиты:

- электронная подпись (аналог собственноручной подписи) для защиты от несанкционированного изменения Информации;

- шифрование данных для защиты от несанкционированного ознакомления с Информацией третьими лицами;

- при хранении и обработке Информации на рабочих станциях и серверах функционирует система разграничения доступа, позволяющая предоставлять доступ к Информации только уполномоченным авторизованным работникам Биржи и препятствовать несанкционированному доступу со стороны иных работников и посторонних лиц.

8. ПОРЯДОК РАЗРАБОТКИ И УТВЕРЖДЕНИЯ ПЛАНА ОНИВД

8.1. На случай возникновения нестандартных и чрезвычайных ситуаций Биржа разрабатывает и поддерживает в актуальном состоянии План ОНИВД, который определяет цели, задачи, порядок, способы и сроки осуществления комплекса мероприятий по предотвращению или своевременной ликвидации последствий возможного нарушения режима повседневного функционирования, вызванного нештатными ситуациями.

8.2. План ОНИВД разрабатывается применительно к нештатным ситуациям, сопоставимым по длительности и силе воздействия, размерам возможных материальных потерь и негативным последствиям нематериального характера с чрезвычайной ситуацией муниципального характера.

8.3. План ОНИВД разрабатывается применительно к критически важным процессам Биржи, которые обеспечиваются критически важными программно-техническими средствами, включая программно-технические средства, с помощью которых обеспечивается проведение организованных торгов (определяемые как средства проведения торгов).

8.4. План ОНИВД утверждается советом директоров Биржи.

8.5. С целью определения возможности выполнения Плана ОНИВД в случае возникновения Нештатных ситуаций Биржей с периодичностью, определенной в Плане ОНИВД, проводится проверка

(тестирование) Плана ОНиВД с моделированием потенциальных чрезвычайных ситуаций и привлечением работников Биржи.

8.6. Не реже одного раза в год проводится профилактический пересмотр (актуализация) Плана ОНиВД с целью проверки достаточности содержащихся в нем мер для обеспечения непрерывности осуществления деятельности по организации торгов и определенных данным планом мер реальным условиям применения Плана ОНиВД и существующим требованиям, а также его соответствия организационной структуре, характеру и масштабам деятельности Биржи, Стратегии развития Биржи.

8.7. План ОНиВД подлежит полному пересмотру в следующих случаях:

- при существенных изменениях перечня решаемых задач, конфигурации технических и программных средств информационных систем, приводящих к существенному изменению технологии обработки информации;

- при изменении приоритетов в значимости угроз безопасности информационных систем;

- при выявлении недостаточности планов мероприятий для обеспечения непрерывности осуществления деятельности Биржи исходя из характера осуществляемой деятельности Биржи и объема совершаемых операций;

- при существенных изменениях требований законодательства, касающихся осуществления непрерывности и восстановления деятельности Биржи.

8.8. План ОНиВД подлежит частичному пересмотру в следующих случаях:

- при существенных изменениях конфигурации, добавлении или удалении программных и технических средств в информационных системах, не изменяющих технологию обработки информации;

- при изменении конфигурации используемых программных и технических средств, не приводящих к изменению технологии обработки информации;

- при изменении перечня критически важных программно-технических средств;

- при изменении состава, обязанностей и полномочий пользователей системы.

8.9. Пересмотр Плана ОНиВД осуществляется специальной комиссией, состав которой утверждается генеральным директором Биржи, в следующем порядке:

- производится оценка актуальности Плана ОНиВД, в том числе посредством анализа изменений в инфраструктуре Биржи, анализа штатного расписания, появления новых офисов, изменений в кадровом составе, а также изменений в законодательстве, регулирующем вопросы обеспечения непрерывности деятельности;

- производится оценка актуальности информационных объектов на предмет появления новых информационных единиц, подлежащих защите;

- производится оценка объектов критически важных программно-технических средств;

- производится анализ актуальности критических процессов;

- производится оценка потенциальных угроз критически важным программно-техническим средствам;

- осуществляется внесение изменений по результатам выявленных недостатков, полученных по результатам тестирования Плана ОНиВД;

- по итогам вышеуказанных действий формируется новая актуализированная редакция Плана ОНиВД, которая согласуется всеми вовлеченными подразделениями Биржи.

8.10. План ОНиВД в обязательном порядке согласовывается с ДепУР, ДВК, ДВА, структурными подразделениями, участвующими в реализации Плана ОНиВД

9. ПЕРЕЧЕНЬ ОБСТОЯТЕЛЬСТВ, НАСТУПЛЕНИЕ КОТОРЫХ МОЖЕТ ПРИВЕСТИ К ПРИОСТАНОВЛЕНИЮ ИЛИ ПРЕКРАЩЕНИЮ ОКАЗАНИЯ ЗНАЧИМЫХ УСЛУГ

9.1. Биржа на постоянной основе осуществляет идентификацию обстоятельств и ситуаций, наступление которых может привести к приостановлению или прекращению осуществления Критически важных процессов, а также при осуществлении хозяйственной деятельности.

9.2. Перечень потенциальных чрезвычайных ситуаций устанавливается в Плане ОНиВД, в частности в него входят:

- пожар;

- ураган;

- захват помещения Биржи террористами;

- угроза взрыва;

- массовые беспорядки и т.д.

9.3. Вместе с тем Биржа предусматривает возможность реализации обстоятельств, вызывающих и/или создающих предпосылки к возникновению сбоев (отказов) при эксплуатации программно-технического комплекса и/или непосредственно препятствующие его нормальному (штатному) функционированию (в том числе, обстоятельств непреодолимой силы, а также сбои, неисправности и

отказы оборудования; сбои и ошибки программного обеспечения; сбои, неисправности и отказы систем связи, энергоснабжения, кондиционирования и других систем жизнеобеспечения, а также иные обстоятельства, такие как случаи нарушения правил разграничения доступа и/или попыток несанкционированного доступа к компьютерной системе, нестандартных ситуаций меньшего масштаба, в том числе связанных с проявлением (по отдельности или в сочетаниях) следующих факторов (далее – нестандартная/нештатная ситуация):

- выход из строя технических средств, сбои в работе информационных систем (в том числе в результате технического сбоя), используемых для обслуживания Критически важных процессов;
- нарушение коммунальной инфраструктуры (затопление помещений Биржи, например, вследствие прорыва труб и т.п.);
- перебои в электроснабжении (в том числе в связи с отказом поставщиков электроэнергии от исполнения своих обязательств), которые не могут быть нейтрализованы имеющимися в распоряжении Биржи техническими средствами;
- нарушение работы каналов связи (в том числе в связи с техническим сбоем, отказом поставщика канала связи выполнять свои обязательства).

Иные обстоятельства, которые по оценке Биржи могут привести к приостановлению или прекращению осуществления Критически важных процессов:

- получение Биржей сообщения от клирингового центра о возникновении чрезвычайной ситуации, которая может привести к нарушению обслуживания участников торгов;
- попытка третьих лиц получить несанкционированный доступ к защищаемой информации, либо умышленное создание условий, осложняющих штатное функционирование программно-технических средств Биржи (сетевые атаки);
- принятие или любые изменения законодательных или иных нормативных правовых актов государственных органов Российской Федерации или нормативных актов Банка России, а также инструкции, указания, заявления, письма, телеграммы или иные действия данных органов, которые временно или на неопределенный срок сделали, делают или могут сделать невозможным или значительно затруднить дальнейшее осуществление деятельности, а также оказания иных значимых услуг в том виде и порядке, в которых данные операции проводились до принятия указанных актов.

10. МЕРЫ, ПРИНИМАЕМЫЕ БИРЖЕЙ В ЧРЕЗВЫЧАЙНЫХ СИТУАЦИЯХ И НАПРАВЛЕННЫЕ НА ОБЕСПЕЧЕНИЕ НЕПРЕРЫВНОСТИ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ ПО ОРГАНИЗАЦИИ ТОРГОВ

10.1. При наступлении чрезвычайной ситуации Биржа осуществляет следующие действия:

10.1.1. всеми имеющимися доступными средствами связи незамедлительно уведомляет Клиринговую организацию, оказывающую Бирже услуги по проведению клиринга, указанную в Правилах проведения организованных торгов, о возникновении нештатной ситуации, которая может привести или привела к нарушению процесса обслуживания Участника торгов/Участников торгов;

10.1.2. всеми имеющимися доступными средствами связи незамедлительно уведомляет Участника торгов/Участников торгов, надзорный орган и иных лиц о возникновении чрезвычайной ситуации;

10.1.3. при нарушении обслуживания Участника торгов/Участников торгов решение о приостановлении торгов принимается генеральным директором в порядке, определяемом Планом ОНИВД;

10.1.4. при необходимости по решению генерального директора формируется кризисная команда в порядке, определяемом Планом ОНИВД.

10.2. При урегулировании чрезвычайной ситуации Биржей могут быть приняты (при необходимости по согласованию с Клиринговой организацией) следующие меры:

- изменение времени окончания торговой сессии, в ходе которой возникла чрезвычайная ситуация;
- изменение сроков осуществления документооборота в процессе взаимодействия Биржи и Клиринговой организацией;
- проведение дополнительной торговой сессии;
- осуществление иных действий, направленных на урегулирование чрезвычайной ситуации.

10.3. Принятые решения по урегулированию чрезвычайной ситуации являются обязательными для исполнения всеми Участниками торгов.

10.4. О мерах, предпринятых в целях урегулирования чрезвычайной ситуации, Участники торгов, Клиринговая организация, надзорный орган и иные заинтересованные лица оповещаются имеющимися доступными средствами связи не позднее дня принятия данных мер.

10.5. Биржа принимает следующие меры, направленные на обеспечение непрерывности осуществления деятельности в условиях чрезвычайной ситуации:

- определение перечня процессов и операций, подлежащих дополнительной защите;

- обеспечение создания на ежедневной основе резервных копий информации о торгах, а также иной информации в рамках процессов и операций, подлежащих дополнительной защите. Резервные копии содержат информацию за последние 5 лет;
- обеспечение наличия резервного комплекса программно-технических средств Биржи, используемых для осуществления деятельности по организации торгов, обеспечивающего выполнение всех процессов и операций, подлежащих дополнительной защите;
- обеспечение расположения основного и резервного комплекса программно-технических средств Биржи, используемых для осуществления деятельности по организации торгов, на территории Российской Федерации;
- обеспечение снабжения основного и резервного комплекса программно-технических средств Биржи, используемых для осуществления деятельности по организации торгов, альтернативными источниками электропитания, позволяющими осуществлять деятельность организатора торговли до окончания текущего рабочего дня;
- обеспечение поддержания технического состояния, технологического и методологического сопровождения резервного офиса на уровне, достаточном для обеспечения возможности функционирования всех Критически важных процессов Биржи и обеспечивается возможность поддержания этих процессов в течение одного месяца с момента возникновения чрезвычайной ситуации;
- разрабатывает и доводит до сведения работников Биржи План обеспечения непрерывности и восстановления деятельности, а также проводит периодическое обучение работников Биржи по вопросам их действий в условиях чрезвычайных ситуаций;

11. МЕРЫ ПО ОБЕСПЕЧЕНИЮ БЕСПЕРЕБОЙНОГО ФУНКЦИОНИРОВАНИЯ КРИТИЧЕСКИ ВАЖНЫХ ПРОГРАММНО-ТЕХНИЧЕСКИХ СРЕДСТВ БИРЖИ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ ПО ОРГАНИЗАЦИИ ТОРГОВ

11.1. Меры, принимаемые для обеспечения бесперебойного функционирования критически важных программно-технических средств, включая программно-технические средства, с помощью которых обеспечивается проведение организованных торгов на основе, применяемого Биржей комплекса технических средств и иного необходимого для работы технических средств оборудования, информационного обеспечения, каналов связи (далее – Оборудование):

- использование в Оборудовании отказоустойчивых технических средств, обеспечивающих резервирование основных подсистем серверного оборудования, систем хранения данных (посредством конфигурирования жестких дисков в отказоустойчивые RAID-массивы), что позволяет избежать простоя Оборудования при сбое единичных компонент серверного оборудования и/или единичных компонентов систем хранения данных серверного оборудования;

- обеспечение наличия достаточной пропускной способности линий связи и коммуникационного оборудования, а также достаточного быстродействия программно-технических средств информационных систем, и возможности их наращивания для обработки возросших объемов операций в периоды повышенной нагрузки;

- обеспечение комплекса мер по контролю за увеличением нагрузки на программно-технические средства Биржи и не допущению превышения объема поступающих заявок участников торгов и частоты их поступления;

- размещение и эксплуатация Оборудования в высокотехнологичном помещении, использования высоконадежных производственных ресурсов для обеспечения функционирования Оборудования;

- обеспечение подключения технических средств серверов к сети Интернет по каналам связи с обеспечением двух независимых бесперебойных круглосуточных каналов связи, а также принятие мер по обеспечению бесперебойности предоставления производственных ресурсов, каналов связи, контролю состояния производственных ресурсов и оборудования;

- принятие оперативных мер по замене вышедших из строя компонентов Оборудования в случае возникновения аппаратных сбоев компонентов Оборудования, во время проведения плановых профилактических работ.

11.2. Меры, принимаемые для обеспечения бесперебойного функционирования комплекса программных средств (далее – ПО):

- использование надежного, высококачественного ПО, обеспечивающего необходимые характеристики надежности и отказоустойчивости, производительности, доступности, масштабирования и эффективности обслуживания;

- конфигурирование ПО с обеспечением балансировки нагрузки на компоненты серверного оборудования и обеспечением продолжения функционирования ПО без простоя в случае выхода из строя единичных компонент серверного оборудования;

- автоматический, а также регулярный ручной контроль функционирования ПО, автоматизированный мониторинг ключевых параметров состояния программных средств в целях раннего

обнаружения потенциальных проблем функционирования общесистемного программного обеспечения и прикладного программного обеспечения, автоматическое уведомление системного администратора о потенциальном возникновении таких проблем по результатам мониторинга параметров состояния ПО;

- мониторинг активности использования участниками торгов ПО;
- постоянная доступность системного администратора ПО для оперативного реагирования в случаях обнаружения потенциальных проблем или сбоев функционирования ПО или его компонентов;
- применение средств защиты информации для обеспечения защиты от несанкционированного доступа к ПО через программные средства, предотвращения изменения данных, недопущение несанкционированного вмешательства в штатный режим функционирования ПО, процессы проведения торгов;
- принятие мер по защите ПО от сетевых атак, в том числе принятие возможных мер по автоматизированному обнаружению и устранению вторжений, применение средств анализа защищенности ПО и мониторинга сетевой безопасности.

12. ПЕРЕЧЕНЬ МЕР, НАПРАВЛЕННЫХ НА ФУНКЦИОНИРОВАНИЕ РЕЗЕРВНОГО КОМПЛЕКСА СРЕДСТВ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ, ФУНКЦИОНАЛЬНО ДУБЛИРУЮЩЕГО ОСНОВНОЙ КОМПЛЕКС СРЕДСТВ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ (ДАЛЕЕ – РЕЗЕРВНЫЙ ОФИС)

12.1. Биржа имеет резервный офис, который функционально дублирует работу основного офиса Биржи в части осуществления Критически важных процессов с целью обеспечения непрерывности деятельности путем оперативного переключения управления на него в случае невозможности осуществления Критически важных процессов в основном офисе.

12.2. При этом Биржей обеспечивается соблюдение следующих характеристик основного и резервного офисов, а также условий организации их функционирования:

- резервный офис на территории Российской Федерации должен находиться в достаточной территориальной отдаленности от основного офиса с учетом возможности работников Биржи продолжить работу в резервном офисе в течение двух часов с момента возникновения чрезвычайных ситуаций;
- обеспечение наличия работоспособных независимых генераторов электричества необходимой мощности в основном и резервном офисах;
- использование не менее двух поставщиков телекоммуникационных услуг для основного и резервного офисов;
- обеспечение возможности начала функционирования резервного офиса Биржи в кратчайшие сроки после возникновения чрезвычайных ситуаций, в том числе возобновления в нем Критически важных процессов в плановое (целевое) время восстановления;
- обеспечение возможности незамедлительного с момента возникновения чрезвычайных ситуаций начала работы по переносу Критически важных процессов, осуществляемых с использованием программно-технических средств Биржи, из основного офиса в резервный офис;
- поддержание технического состояния, технологического и методологического сопровождения резервного офиса на уровне, достаточном для обеспечения возможности функционирования всех Критически важных процессов Биржи и обеспечения возможности поддержания этих процессов в течение одного месяца с момента возникновения чрезвычайной ситуации;
- резервное копирование информации и баз данных, обслуживающих Критически важные процессы, на резервные носители информации для возобновления указанных процессов в случае утраты или повреждения информации или баз данных вследствие возникновения чрезвычайных ситуаций, и хранение указанных копий в течение пяти лет со дня их создания.

13. ПОРЯДОК РАСПРЕДЕЛЕНИЯ ОТВЕТСТВЕННОСТИ И ПОЛНОМОЧИЙ МЕЖДУ СТРУКТУРНЫМИ ПОДРАЗДЕЛЕНИЯМИ БИРЖИ И ИХ РАБОТНИКАМИ В СЛУЧАЕ СУЩЕСТВЕННЫХ СОБЫТИЙ ОПЕРАЦИОННОГО РИСКА И (ИЛИ) ВЫЯВЛЕНИЯ ЧРЕЗВЫЧАЙНЫХ СИТУАЦИЙ

13.1. При обнаружении любого события, влекущего прерывание деятельности Биржи и снижение уровня ее услуг (далее – инцидент):

13.2. Работник, ставший свидетелем инцидента, незамедлительно связывается с руководителем своего подразделения, который принимает решение о его значительности и о способности подразделения Биржи продолжать работу.

13.3. Руководитель структурного подразделения:

- наиболее полно, по возможности, оценивает сложившуюся обстановку, возможные последствия, основные причины;
- в случае необходимости оповещает соответствующую аварийную службу;
- принимает решение о значительности события и о способности структурного подразделения

продолжать работу в штатном режиме, а также о степени возможного влияния инцидента на работу других подразделений и доводит эту информацию до генерального директора Биржи (должностного лица, выполняющего функции генерального директора Биржи);

- информирует ответственные подразделения или работников Биржи, выполнение функций которых необходимо для поддержания деятельности Биржи.

13.4. Генеральным директором Биржи (должностным лицом, выполняющим функции генерального директора Биржи) принимаются решения необходимые для минимизации последствий выявленного инцидента.

13.5. В случае необходимости генеральный директор Биржи (должностное лицо, выполняющее функции генерального директора Биржи) принимает решение о начале работы в чрезвычайном режиме (признании ситуации чрезвычайной).

13.6. После принятия решения о начале работы в чрезвычайном режиме (признания ситуации чрезвычайной) работа осуществляется по одному из кризисных Планов ОНиВД.

14. МЕРЫ, ПРИНИМАЕМЫЕ БИРЖЕЙ ПО ЗАЩИТЕ ИНФОРМАЦИИ И ДОКУМЕНТОВ, СВЯЗАННЫХ С ПРОВЕДЕНИЕМ ОРГАНИЗОВАННЫХ ТОРГОВ

14.1. При осуществлении деятельности по организации торгов Биржа использует следующие механизмы и методы по защите информации и документов, связанных с организацией торгов:

- обеспечение защиты информации при управлении доступом и регистрацией;
- обеспечение защиты информации на этапах жизненного цикла автоматизированных систем;
- обеспечение защиты информации средствами антивирусной защиты;
- обеспечение защиты информации при использовании ресурсов информационно-телекоммуникационной сети Интернет;
- обеспечение процедур безопасности и контроля (криптография, кодирование, защита от несанкционированного доступа во время передачи или хранения информации, ограничивающее доступ к данным программное обеспечение, аутентификация и авторизация участников);
- обеспечение защиты информации при назначении и распределении ролей;
- организация деятельности Управления информационной безопасности;
- управление рисками нарушения защиты информации;
- регламентация и документирование деятельности по обеспечению защиты информации, включая порядок регистрации и хранения информации;
- повышение осведомленности работников в области обеспечения защиты информации;
- обнаружение инцидентов информационной безопасности и реагирование на них;
- мониторинг и анализ обеспечения защиты информации;
- своевременное совершенствование обеспечения защиты информации.-
- обеспечение долгосрочного планирования информационных и компьютерных систем, спецификации требований к ним, выбора поставщиков и контроля за проектами создания систем и технологий обработки и передачи данных для Биржи;
- обеспечение доступа персонала только к сведениям, необходимым для выполнения прямых служебных обязанностей в пределах предоставленных полномочий;
- ограничение доступа путем использования возможностей программного обеспечения;
- наличие систем разграничения доступа к разным уровням баз данных и операционной среды на уровне локальной сети;
- размещение имущества Биржи в помещениях, доступ в которые регулируется пропускным режимом;
- обеспечение процедур бесперебойного функционирования программно-технических средств Биржи, используемых для осуществления деятельности по организации торгов, в том числе:
 - наличие полностью резервированной архитектуры вычислительного комплекса, не содержащей нерезервированных точек отказа и обладающей устойчивостью к некротным аппаратным отказам любого типа компонентов, способных обеспечить функционирование основных электронных систем, используемых Биржей;
 - наличие поддерживаемого в актуальном состоянии плана действий при возникновении необходимости использования резервных мощностей и компонентов вычислительного центра и регулярной практической отработки мероприятий, предусмотренных этим планом;
 - порядок восстановления работоспособности нарушенных внутренних процессов и систем и возврата к режиму нормальной работы;
 - наличие встроенных в прикладные системы проектных решений, обеспечивающих распределение нагрузки и взаимное дублирование на уровне серверов доступа и основных серверов обработки данных;
 - использование в качестве платформы для наиболее критичных задач высокодоступных кластеров

со встроенным дублированием основных компонентов;

- использование телекоммуникационных устройств со штатным дублированием основных блоков;
- использование для хранения баз данных и другой критичной информации устройств хранения данных с полностью резервированной архитектурой;
- наличие и неукоснительное выполнение процедур регулярного (не реже 1 раза в сутки) резервного копирования всех критичных данных, предусматривающих хранение и регулярное обновление резервных копий;
- наличие резервных универсальных рабочих мест;
- наличие в помещении вычислительного центра автоматической системы пожаротушения;
- наличие круглосуточного мониторинга состояния вычислительных и телекоммуникационных ресурсов, помещений вычислительного центра Биржи;
- перераспределение функций, полномочий и обязанностей подразделений и работников;
- меры по поддержанию адекватного информационного обеспечения, оценку готовности к чрезвычайной ситуации внешних поставщиков информационных услуг.

14.2. При хранении и обработке информации и документов, связанных с организацией торгов на рабочих станциях и серверах функционирует система разграничения доступа, позволяющая предоставлять доступ к данным только авторизованным работникам, и препятствовать несанкционированному доступу со стороны всех остальных работников и посторонних лиц. Эта система функционирует как на уровне системных и сетевых средств, так и в приложениях, используемых Биржей.

14.3. На Бирже определены, выполняются, регистрируются и контролируются правила и процедуры мониторинга доступа к информации, анализа и хранения данных о действиях и операциях работников, позволяющие выявлять неправомерные или подозрительные операции.

14.4. На Бирже реализовано ведение журналов действия и операций автоматизированных рабочих мест, серверного и сетевого оборудования, межсетевых экранов с целью их использования при реагировании на инциденты с информацией и документами, .

14.5. Процедуры мониторинга информации и анализа данных о действиях и операциях используют зафиксированные критерии выявления неправомерных или подозрительных действий и операций. Указанные процедуры мониторинга и анализа применяются на регулярной основе ко всем выполненным действиям и операциям.

14.6. Ответственность за защиту и контроль доступа к информации несет Департамент информационной безопасности Биржи.

15. ПОРЯДОК ОЦЕНКИ ЭФФЕКТИВНОСТИ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ И ФОРМИРОВАНИЯ ОТЧЕТНОСТИ ПО РИСКАМ

15.1. В рамках управления рисками не реже одного раза в год осуществляется оценка эффективности управления рисками посредством анализа результативности деятельности по выявлению нарушений ограничений рисков, их устранению и (или) осуществлению мероприятий по снижению рисков или их исключению.

15.2. Оценка эффективности системы управления рисками Биржи, осуществляется советом директоров на основе следующей информации:

- информации о достигнутом уровне рисков и соблюдении установленных ограничений рисков;
- информации об объеме убытков, полученных Биржей при осуществлении деятельности по организации торгов;
- о состоянии контрольных показателей операционного риска;
- о результатах мер, направленных на устранение превышения контрольных показателей операционного риска (при их наличии);
- отчетов ДВА о результатах проверки функционирования системы управления рисками.

15.3. ДВА в соответствии с утвержденным советом директоров Планом работы осуществляет проверку организации и функционирования системы управления рисками, связанной с осуществлением деятельности организации торгов, включая оценку эффективности выполнения внутренних документов Биржи, определяющих требования к системе управления рисками, и предоставляет отчет о результатах проверки совету директоров.

15.4. По завершении отчетного года директор ДепУР осуществляет анализ совокупности информации о рисках и оценивает результативность функционирования системы управления рисками посредством оценки выполнения критериев, определяющих эффективность системы управления рисками, установленных в п. 15.6 настоящих Правил. Результаты оценки могут быть включены в текущий Отчет о состоянии системы управления рисками за квартал, либо в самостоятельный отчет об эффективности системы управления рисками и направлены на рассмотрение органам управления Биржи.

15.5. По итогам анализа результатов прошедшего календарного года совет директоров Биржи дает оценку эффективности функционирования системы управления рисками.

15.6. Система управления рисками признается эффективной при выполнении следующих критериев:

- отсутствуют значительные (и/или выше) потери от деятельности по осуществлению торгов, влияющие на финансовую устойчивость Биржи;
- соблюдаются установленные ограничения рисков;
- обеспечивается своевременность стресс-тестирования программно-технических средств проведения торгов Биржи;
- выполняются показатели непрерывности деятельности Биржи как организатора торгов;
- выполняются мероприятия по снижению рисков;
- выполняются контрольные показатели операционного риска;
- своевременно и результативно выполняются меры, направленные на устранение превышения контрольных показателей операционного риска (при их наличии);
- своевременно проводится операционный аудит;
- своевременно выполняются рекомендации ДВА и ДВК.

15.7. Если результаты оценки эффективности функционирования системы управления рисками будут признаны неудовлетворительными, совет директоров принимает решения, направленные на устранение выявленных недостатков и приведение системы управления рисками в соответствие характеру и масштабам деятельности Биржи.

15.8. В рамках своей компетенции совет директоров Биржи может принять решение о развитии (совершенствовании) системы управления рисками исходя из стратегических задач Биржи с учетом международного опыта и опыта российских организаций в области управления рисками, прочих внешних и внутренних факторов, способных повлиять на качество управления рисками.

15.9. В целях обеспечения эффективности управления рисками основные принципы и подходы в управлении рисками пересматриваются и актуализируются ДепУР по мере необходимости, в составе Правил.

15.10. Директор ДепУР осуществляет формирование следующих отчетов о рисках Биржи:

- ежеквартальный отчет о состоянии системы управления рисками;
- отчет о выявленном нарушении.

15.11. Ежеквартальный отчет о состоянии системы управления рисками включает в себя аналитическую часть, в которой интерпретируются полученные результаты и даются рекомендации в отношении мероприятий по управлению рисками, и в том числе содержит:

- оценку рисков и обоснование уровня рисков по основным направлениям деятельности Биржи;
- сведения о фактах возникновения убытков, нарушений, а так же превышения Ограничений рисков;
- сведения о причинах и результатах расследования фактов возникновения убытков, нарушений, а так же превышения Ограничений рисков;
- меры, принятые для устранения выявленных нарушений и снижения рисков;
- сведения о рекомендациях ДепУР по снижению/устранению выявленных рисков;
- сведения о выполнении рекомендаций ДепУР по снижению/устранению выявленных рисков;
- сведения об исполнении Плана мероприятий по снижению значимых рисков Биржи или их исключению (в случае выявления значимых рисков и составления Плана мероприятий по снижению значимых рисков Биржи или их исключению);
- сведения об оценке актуальности реестра рисков Биржи;
- сведения о результатах Самооценки рисков Биржи (в случае проведения самооценки в отчетном периоде);
- сведения о состоянии контрольных показателей операционного риска Биржи;
- сведения о результатах мер, направленных на устранение превышения контрольных показателей операционного риска (при их наличии);
- сведения об обнаружении недостатков в работе средств проведения торгов, а также о несоответствии программно-технических средств характеру и объему совершаемых Биржей операций, выявленные в результате испытательных работ (тестирования) средств проведения торгов;
- сведения об исполнении рекомендаций по устранению недостатков в работе средств проведения торгов, а также, в случае необходимости, рекомендаций по улучшению (обновлению) программно-технических средств;
- иные сведения о рисках, которые директор ДепУР считает необходимым указать.

Ежеквартальный отчет направляется на рассмотрение совету директоров Биржи, правлению Биржи и генеральному директору Биржи не позднее 30 (тридцати) дней с даты окончания очередного квартала в порядке, предусмотренном пунктами 15.12 и 15.13 настоящих Правил.

15.12. Ежеквартальный отчет о состоянии системы управления рисками в электронной форме в виде электронного формата (документ на бумажном носителе, преобразованный в электронную форму путем сканирования с сохранением его реквизитов или путем сохранения документа в формате PDF) ежеквартально не позднее 30 (тридцати) дней с даты окончания отчетного квартала направляется лицу,

осуществляющему функции секретаря совета директоров/ правления Биржи по электронной почте для включения вопроса о рассмотрении Ежеквартального отчета о состоянии системы управления рисками в повестку ближайшего заседания совета директоров и правления с учетом сроков корпоративных процедур, сопровождающих организацию совета директоров и правления.

15.13. Ежеквартальный отчет о состоянии системы управления рисками направляется генеральному директору Биржи в электронной форме Директором ДепУР не позднее 30 (тридцати) дней с даты окончания отчетного квартала.

15.14. Отчет о выявленном нарушении формируется в случае выявления событий риска с высокими убытками, а также существенного превышения Ограничений рисков вследствие реализации рисков событий.

15.15. Отчет о выявленном нарушении содержит:

- сведения о выявленном нарушении;
- меры, принятые для устранения выявленного нарушения;

15.16. Отчет о нарушении направляется генеральному директору Биржи, правлению Биржи, а также, по усмотрению директора ДепУР, руководителям структурных подразделений Биржи не позднее 10 (десяти) рабочих дней с даты выявления соответствующего нарушения.

16. ПОРЯДОК И ПЕРИОДИЧНОСТЬ ПРОВЕДЕНИЯ СТРЕСС-ТЕСТИРОВАНИЯ ПРОГРАММНО-ТЕХНИЧЕСКИХ СРЕДСТВ ПРОВЕДЕНИЯ ТОРГОВ, А ТАКЖЕ ТРЕБОВАНИЯ К СЦЕНАРИЯМ, ИСПОЛЬЗУЕМЫМ ДЛЯ СТРЕСС-ТЕСТОВАНИЯ

16.1. Биржа производит испытательные работы в отношении критически важных программно-технических средств при их введении в эксплуатацию, в том числе при их обновлении, с учетом возможного изменения объемов проводимых операций. По итогам проведенных испытательных работ проводится устранение недостатков, выявленных в работе критически важных программно-технических средств, по итогам проведенных испытательных работ. Испытательные работы в части действующих критически важных программно-технических средств проводятся с периодичностью каждые 6 месяцев.

16.2. Биржа производит тестирование программно-технических средств, используемых для осуществления деятельности по организации торгов путем имитации технических условий проведения реальных организованных торгов, а при необходимости – путем проведения пробной эксплуатации (далее – стресс-тестирование).

16.3. Стресс-тестирование состоит из следующих компонентов:

- нагрузочное тестирование;
- тестирование отказоустойчивости.

16.4. Нагрузочное тестирование представляет моделирование существенного увеличения нагрузки на программно-технические средства Биржи. В рамках данного подхода моделируется сценарий с увеличением нагрузки на 50%. В случае если ожидается более существенное увеличение нагрузки, величина 50% может быть скорректирована в большую сторону.

16.5. Тестирование отказоустойчивости представляет моделирование сценария снижения производительности (отказа) ключевых компонентов системы. В качестве сценариев рассматриваются:

- отказ одного из узлов кластера;
- отказ системы архивации;
- отказ телекоммуникационного оборудования.

16.6. Стресс-тестирование проводится:

- при ожидании существенного увеличения нагрузки на систему (нагрузочное тестирование);
- при возникновении риска снижения работоспособности (отказа) какого-либо из частей системы (тестирование отказоустойчивости);
- при обновлении компонентов системы (тестирование отказоустойчивости);
- каждые 6 месяцев проводится комплексное стресс-тестирование (нагрузочное тестирование и тестирование отказоустойчивости).

16.7. Отчет о проведении стресс-тестирования составляется ответственным за проведение стресс-тестирования работником и предоставляется в ДепУР. Информация о результатах стресс-тестирования доводится до сведения генерального директора Биржи посредством включения в регулярную отчетность о рисках в составе информации об операционном риске. В случае выявления недостатков / нарушений в работе средств проведения торгов, выявленных в результате стресс-тестирования, в отчете отражаются выявленные недостатки / нарушения и рекомендации по устранению выявленных недостатков / нарушений. При выявленных недостатках/ нарушениях по результатам стресс-тестирования средств проведения торгов ДепУР организует мероприятия по их устранению. Информация об исполнении мероприятий отражается в Ежеквартальном отчете о состоянии управления рисками за прошедший квартал.

17. ЗАКЛЮЧИТЕЛЬНЫЕ ПОЛОЖЕНИЯ

17.1. Требования настоящих Правил подлежат обязательному исполнению работниками всех подразделений Биржи.

17.2. Работники ДепУР вправе требовать у работников и должностных лиц Биржи предоставления информации (документов), в том числе письменных объяснений, по вопросам, возникающим в ходе выполнения им своих обязанностей.

17.3. Лица, нарушающие или не исполняющие требования настоящих Правил, привлекаются к дисциплинарной или административной в соответствии с законодательством Российской Федерации.

17.4. Руководители структурных подразделений Биржи несут персональную ответственность за исполнение обязанностей их подчиненными.

17.5. Настоящие Правила утверждаются советом директоров Биржи.

17.6. В случае изменения законодательства Российской Федерации, внесения изменений во внутренние документы Биржи, до приведения настоящих Правил в соответствие с такими изменениями, Правила действуют в части не противоречащей таким изменениям.

**Контрольные показатели операционного риска Биржи
в разрезе источников возникновения операционного риска**

В целях контроля операционного риска, возникающего в деятельности Биржи, определены следующие контрольные показатели в разрезе источников возникновения операционного риска. Показатели определяются на годовой период.

1. Контрольные показатели по источнику операционного риска «Ошибки в функционировании программно-технических средств» в части риска информационных систем

Показатель и его определение	Определение пороговых значений показателей	
	Сигнальные значения	Контрольные значения
- показатель Д0, характеризующий уровень устойчивости программно-технических средств Биржи к отказам в его работе, рассчитываемый как отношение фактической продолжительности рабочего времени программно-технических средств Биржи как организатора торгов к суммарной нормативной продолжительности рабочего времени программно-технических средств Биржи;	Сигнальные значения показателей определяются на основе экспертной оценки приближения расчетных значений к контрольным показателям, обеспечивающим соблюдение показателей операционной надежности, установленных в рамках событий операционного риска, вызванных нарушением функционирования программно-технических средств организатора торгов, установленных положением по управлению операционной надежностью деятельности ПАО «СПБ Биржа»	Контрольные значения показателей определяются на основе значений, обеспечивающих соблюдение показателей операционной надежности, установленных в рамках событий операционного риска, вызванных нарушением функционирования программно-технических средств организатора торгов, установленных положением по управлению операционной надежностью деятельности ПАО «СПБ Биржа»
- показатель Tmax, определяемый как максимальное время простоя вследствие нарушения непрерывности функционирования программно-технических средств организатора торгов;		
- показатель Tср, определяемый как среднее время восстановления работоспособности программно-технических средств организатора торгов после нарушений в его работе и рассчитывается как среднее арифметическое времени восстановления при нарушениях работоспособности программно-технических средств.		
- число ИТ-инцидентов, приводящих к недоступности программно-технических средств организатора торгов с превышением установленного времени восстановления работоспособности программно-технических средств проведения торгов		
	Выявление единичного факта сбоя ПО, оборудования, приведших к приостановке торгов с превышением установленного времени восстановления работоспособности программно-технических средств проведения торгов	Увеличение частоты фактов сбоя ПО, оборудования, приведших к приостановке торгов с превышением установленного времени восстановления работоспособности программно-технических средств проведения торгов

2. Контрольные показатели по источнику операционного риска «Внешние события и (или) действия или бездействие третьих лиц» в части риска информационной безопасности:

Показатель и его определение	Определение пороговых значений показателей	
	Сигнальные значения	Контрольные значения
- количество инцидентов информационной безопасности на объектах информационной инфраструктуры Биржи (элемент критичной инфраструктуры ¹); - количество инцидентов, приведших к утечке конфиденциальной информации; - количество инцидентов, приведших к нарушению целостности данных; - количество инцидентов, приведших к утрате (нарушению сохранности) данных, входящих в состав элементов критичной архитектуры; - количество сбоев работы элементов критичной архитектуры вследствие воздействия вредоносного кода и несанкционированного доступа;	По данной группе показателей: количество несущественных ИБ-инцидентов, не повлекших репутационный ущерб и вызвавших деградацию/отсутствие сервиса, не превышающую допустимое время простоя и (или) деградации Технологического процесса определяется на основе не превышения статистических значений предшествующих периодов	По данной группе показателей: количество существенных ИБ-инцидентов, повлекших репутационный ущерб и вызвавших деградацию/отсутствие сервиса, превышающую допустимое время простоя и (или) деградации Технологического процесса установлена нулевая толерантность (недопустимость случаев)

3. Контрольные показатели по источнику операционного риска «Несовершенство внутренних бизнес-процессов»:

Показатель и его определение	Определение пороговых значений показателей	
	Сигнальные значения	Контрольные значения
- Количество событий операционного риска с уровнем существенный или значимый по источнику несовершенство внутренних бизнес-процессов, повлекших нарушение правил, порядка, процесса организации торгов	Сигнальные значения показателей определяются на основе экспертной оценки приближения расчетных значений показателей, определяемых по статистическим данным Базы событий операционного риска к количеству фактов событий операционного риска с данным источником за годовой предшествующий период	Контрольные значения показателей определяются на основе статистических данных по Базе событий операционного риска на основе не превышения годового количества фактов событий операционного риска по данному источнику за предшествующий период

4. Контрольные показатели по источнику операционного риска «Действия (бездействие) работников»:

Показатель и его определение	Определение пороговых значений показателей	
	Сигнальные значения	Контрольные значения
- Количество событий операционного риска с уровнем существенный или значимый по источнику действия (бездействие) работников, повлекших нарушение правил,	Сигнальные значения показателей определяются на основе экспертной оценки приближения расчетных значений	Контрольные значения показателей определяются на основе статистических данных по Базе событий

порядка, процесса организации торгов	показателей, определяемых по статистическим данным Базы событий операционного риска к количеству фактов событий операционного риска с данным источником за годовой предшествующий период	операционного риска на основе не превышения годового количества фактов событий операционного риска по данному источнику за предшествующий период
--------------------------------------	--	--

5. Контрольные показатели операционного риска в части материальных потерь от реализации операционного риска:

Показатель и его определение	Определение пороговых значений показателей	
	Сигнальные значения	Контрольные значения
- Величина потерь от реализации событий операционного риска Определяется как совокупная величина финансовых потерь (прямых и потенциальных потерь) в результате реализации событий операционного риска, отраженная в регистрах бухгалтерского учета.	Наличие материальных потерь в размере менее 2,5% от капитала	Наличие материальных потерь в размере свыше 2,5% от капитала

ⁱ Элементами критичной архитектуры являются:

технологические процессы критически важных процессов, реализуемых Биржей в рамках деятельности по организации торгов;

подразделения (работники) Биржи, ответственные за разработку технологических процессов критически важных процессов, реализуемых Биржей в рамках деятельности по организации торгов;

объекты информационной инфраструктуры Биржи, задействованные при выполнении каждого технологического процесса критически важных процессов, реализуемых Биржей в рамках деятельности по организации торгов;

технологические участки технологических процессов критически важных процессов, реализуемых Биржей в рамках деятельности по организации торгов;

технологических процессов критически важных процессов, реализуемых внешними контрагентами Биржи (при наличии), оказывающими услуги в сфере информационных технологий, связанные с выполнением технологических процессов (поставщики услуг);

работники Биржи или иные лица, осуществляющие физический и (или) логический доступ, или программные сервисы, осуществляющих логический доступ к объектам информационной инфраструктуры Биржи (субъекты доступа), задействованные при выполнении каждого технологического процесса критически важных процессов, реализуемых Биржей в рамках деятельности по организации торгов;

взаимосвязи и взаимозависимости между Биржей и иными некредитными финансовыми организациями, кредитными организациями и поставщиками услуг в рамках выполнения технологических процессов критически важных процессов, реализуемых Биржей в рамках деятельности по организации торгов (при совместном упоминании - участники технологического процесса);

каналы передачи защищаемой информации, обрабатываемой и передаваемой в рамках технологических процессов критически важных процессов, реализуемых Биржей в рамках деятельности по организации торгов.