

УТВЕРЖДЕНО
Советом директоров
ПАО «Санкт-Петербургская биржа»
(протокол №6/2020 от 31.03.2020 г.)

ПРАВИЛА
УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ ПО ОРГАНИЗАЦИИ ТОРГОВ

Москва
2020

Содержание

1. Общие положения.....	3
2. Система управления рисками, связанными с осуществлением деятельности Биржи..	4
2.1. Принципы управления рисками.....	4
2.2. Цели и задачи управления рисками.....	4
2.3. Полномочия и функции органов управления Биржи, ДепУР, а также структурных подразделений Биржи в рамках системы управления рисками.....	5
2.4. Требования к структуре корпоративного управления Биржи в связи с управлением рисками.....	9
3. Основные риски, связанные с осуществлением деятельности Биржи.....	11
4. Основные подходы к идентификации, оценке, мониторингу и контролю рисков.....	12
4.1. Операционный риск.....	12
4.2. Риск потери деловой репутации.....	14
4.3. Стратегический риск.....	15
4.4. Риск, связанный с совмещением деятельности по проведению организованных торгов с иными видами деятельности.....	16
4.5. Рыночный риск.....	17
4.6. Анализ рисков, проведение оценки рисков и определение метода воздействия на риски...17	
4.7. Мониторинг и контроль рисков.....	18
5. Порядок действий Биржи, связанный с управлением рисками при оказании поставщиками услуг внешних услуг в течение всего периода их оказания, а также в случае отказа поставщика услуг от исполнения своих обязательств.....	20
6. Меры, предпринимаемые Биржей для обеспечения конфиденциальности и защиты информации о рисках Биржи, а также информации, предоставляемой Биржей поставщику услуг.....	21
7. Порядок разработки и утверждения Плана ОНиВД.....	23
8. Перечень обстоятельств, наступление которых может привести к приостановлению или прекращению оказания значимых услуг.....	24
9. Меры по обеспечению бесперебойного функционирования программно-технических средств Биржи, используемых для осуществления деятельности по организации торгов.....	26
10. Перечень мер, направленных на функционирование резервного комплекса средств проведения торгов, функционально дублирующего основной комплекс средств проведения торгов (далее – Резервный офис).....	28
11. Порядок распределения ответственности и полномочий между структурными подразделениями Биржи и ее сотрудниками в случае реализации существенных событий рисков и (или) выявления чрезвычайных ситуаций.....	29
12. Меры, принимаемые Биржей по защите информации и документов, связанных с проведением организованных торгов.....	30
13. Проверка эффективности управления рисками и отчетность по рискам.....	32
14. Порядок и периодичность проведения стресс-тестирования средств проведения торгов, а так же требования к сценариям, используемым для такого тестирования..	34
15. Заключительные положения.....	35

1. Общие положения

1.1. Настоящие Правила управления рисками деятельности по организации торгов (далее - Правила) являются внутренним документом Публичного акционерного общества «Санкт-Петербургская 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 N 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 N 437-П "О деятельности по проведению организованных торгов";
- 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:

- классифицируют риски, присущие Бирже;
- устанавливают порядок и сроки проведения проверок эффективности управления рисками;
- 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 неэкономическими рисками.

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

2. Система управления рисками, связанными с осуществлением деятельности Биржи

2.1. Принципы управления рисками.

2.1.1. Система управления рисками Биржи строится в соответствии со следующими принципами:

- **Принцип ценности** предполагает, что Совет директоров и исполнительные органы Биржи должны формировать корпоративную культуру, которая основана на надежном управлении рисками, а также поддерживать и создавать надлежащие стандарты и стимулы ответственного профессионального поведения.

- **Принцип комплексности** предполагает выявление источников и объектов риска на основе всестороннего анализа существующих и планируемых к вводу бизнес-процессов и продуктов, проведение процедур оценки и управление рисками по основной деятельности Биржи в тесной связи с системой управления рисками по направлениям, не относящимся к основной деятельности.

- **Принцип вовлеченности** предполагает участие в функционировании системы управления Биржи всех структурных подразделений Биржи. Сотрудники Биржи обязаны незамедлительно доводить до сведения своего непосредственного руководителя и ДепУР, информацию о возможных и совершенных нарушениях Закона об организованных торгах, принятых в соответствии с ним нормативных актов Банка России, устава и внутренних документов Биржи, связанных с деятельностью Биржи.

- **Принцип непрерывности** предполагает проведение на регулярной основе необходимого набора упорядоченных, целенаправленных процедур, таких как оценка текущих рисков, анализ технологии и регламентов функционирования системы управления рисками, предоставление отчетности органам управления.

- **Принцип открытости** проявляется в том, что Биржа обеспечивает заинтересованные стороны необходимой информацией, описывающей систему управления рисками, в том числе документами, описывающими систему управления рисками, методологические подходы по оценке рисков, а также ключевые аспекты процедур мониторинга финансовой устойчивости контрагентов. При этом результаты оценок конкретных контрагентов, выраженные во внутренних рейтингах, не являются публичной информацией и не подлежат раскрытию.

- **Принцип независимости** оценок означает, что комплексная оценка и анализ рисков осуществляется отдельными структурными подразделениями/сотрудниками, независимыми от подразделений, ответственных за принятие рисков и контрагентов. На указанные структурные подразделения/сотрудников не могут быть возложены обязанности, исполнение которых может привести к возникновению конфликта интересов.

- **Принцип существенности** означает, что 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.

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, воздействию 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. Цель управления рисками достигается на основе системного, комплексного подхода, который подразумевает 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;

- 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;

- 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 рискового 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. Полномочия и функции органов управления Биржи, ДепУР, а также структурных подразделений Биржи в рамках системы управления рисками.

2.3.1. Органы управления Биржи обязаны развивать корпоративную культуру и этические нормы, демонстрирующие всем сотрудникам Биржи важность управления рисками и способствующие осознанию рисков. Корпоративная культура и этические ценности Биржи должны учитывать решающее значение своевременного и откровенного обсуждения возникающих проблем. Все сотрудники Биржи, исходя из их полномочий и ответственности, должны быть вовлечены в деятельность по управлению рисками и рассматривать ее как часть своих функциональных обязанностей.

2.3.2. 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 основных методов контроля и (или) минимизации риска (принятие мер по поддержанию риска на уровне, не угрожающем интересам участников торгов, контрагентов и устойчивости Биржи);
- представление в установленном распорядительными документами 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.

2.3.3. К компетенции Совета директоров Биржи относится определение принципов и подходов к организации системы управления рисками, включая, в том числе, следующее:

- определение структуры корпоративного управления Биржи;
- 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;
- 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 (далее – Ограничения рисков);
- контроль за выполнением процессов и мероприятий по управлению рисками, предусмотренных Правилами, в том числе анализ информации и контроль за выполнением рекомендаций, полученных в соответствии с п. 13.4. 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.
- 2.3.4. К компетенции исполнительных органов управления Биржи относится тактическое управление рисками, включая, в том числе, следующее:
- организация разработки и внедрения внутренних документов, регламентирующих правила и процедуры управления рисками;
 - обеспечение принятия внутренних документов, определяющих правила 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. 13.4- 13.6, 14.2-14.4 Правил, посредством рассмотрения отчетов о состоянии рисков, отчетов о результатах стресс-тестирования средств проведения торгов на рынке ценных бумаг и товарном рынке;
 - установление допустимого уровня и совокупного допустимого уровня по всем выявленным рискам Биржи;
 - 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.
- 2.3.5. Текущее управление рисками Биржи осуществляется ДепУР, а так же сотрудниками Биржи в пределах своей компетенции. Руководителем ДепУР является Директор ДепУР Биржи.
- 2.3.6. На должность Директора ДепУР назначается штатный сотрудник Биржи, соответствующий требованиям, установленным законодательством Российской Федерации.
- 2.3.7. Назначение на должность Директора ДепУР допускается с учетом ограничений, установленных Федеральным законом «Об организованных торгах» и принятыми в соответствии с ним нормативными актами.
- 2.3.8. ДепУР не вправе осуществлять функции, которые не связаны с управлением рисками и осуществлением Биржей внутреннего контроля, за исключением случаев, установленных настоящими Правилами.
- 2.3.9. При исполнении своих обязанностей ДепУР независим от других должностных лиц и структурных подразделений Биржи.
- 2.3.10. 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.
- 2.3.11. Сотрудники ДепУР могут входить в состав создаваемых Биржей комитетов и комиссий, не являющихся структурными подразделениями Биржи.
- 2.3.12. К компетенции ДепУР входит:
- проведение обучения (консультаций) сотрудников Биржи по вопросам выявления, идентификации, оценки и снижения рисков;
 - 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;
- 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. 13.3 настоящих Правил;
- доведение до сотрудников 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.

2.3.13. ДепУР должен быть наделен 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 сотрудников 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 комитетов и т.п.;
- правом Директора ДепУР на непосредственное обсуждение вопросов рисков с Генеральным директором Биржи.

2.3.14. Все структурные подразделения Биржи в рамках своих полномочий обязаны учитывать аспекты управления рисками, координировать свою деятельность с ДепУР и обмениваться с ним данными. Взаимодействие структурных подразделений Биржи с ДепУР по вопросам, связанным с управлением рисками, осуществляется в соответствии с внутренними документами Биржи.

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

2.3.16. В отношении управления рисками наиболее важными является:

- соблюдение процедур по обеспечению непрерывности деятельности Биржи;
- обеспечение мер по сохранению деловой репутации Биржи;
- соблюдение установленных лимитов и ограничений на проводимые операции;
- соблюдение требований по составу и структуре активов;
- контроль за движением денежных средств;
- обеспечение предстоящих платежей;
- соблюдение соответствия активов и пассивов баланса по срокам исполнения;
- 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;
- выявление и своевременное урегулирование внутренних конфликтов между сотрудниками или между сотрудниками и Биржей;
- информирование новых работников о корпоративной культуре Биржи, принятых этических нормах и принципах управления рисками;
- своевременное урегулирование претензий, предъявленных к Бирже (ее сотрудникам).

2.4. Требования к текущему управлению 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 сотрудников подразделений Биржи и принятие бизнес – решений, ограничение концентрации полномочий, соответствие объемов полномочий и ответственности структурных подразделений, органов управления Биржи, управленческого персонала и сотрудников, внедрение формализованных коллегиальных процедур принятия бизнес - решений;
- исключение возможностей совмещения исполнительских и контрольных функций подразделениями, управленческим персоналом и сотрудниками 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 сотрудников Биржи, фрагментация бизнес – процессов, процедур и технологий на отдельные элементы с тем, чтобы одно подразделение, лицо из числа управленческого персонала или сотрудник 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 возникновения расходов (убытков) в результате сбоя и (или) ошибок программно-технических систем Биржи, включая программно-технические средства и информационно-коммуникационные средства связи, с помощью которых обеспечивается проведение организованных торгов, и (или) во внутренних бизнес-процессах Биржи, ошибок работников Биржи и (или) в результате внешних событий, оказывающих негативное воздействие на деятельность по организации торговли.
- 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. **Риск, связанный с совмещением различных видов деятельности** - риск возникновения расходов (убытков), связанный с возможностью возникновения конфликта интересов в результате совмещения Биржей различных видов деятельности.
- 3.6. **Рыночный риск** - риск возникновения расходов (убытков) вследствие неблагоприятного изменения рыночной стоимости финансовых инструментов или иных активов, в которые инвестированы средства Биржи.
- 3.7. **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 развития Биржи (Стратегия 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.
- 3.8. **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 Департаментом внутреннего контроля Биржи.
- 3.9. **Кредитный риск** - риск возникновения у Биржи убытков вследствие неисполнения, несвоевременного либо неполного исполнения контрагентом финансовых обязательств перед Биржей в соответствии с условиями договора.

4. Основные подходы к идентификации, оценке, мониторингу и контролю рисков.

4.1. Операционный риск.

4.1.1. Для управления операционным риском Биржа:

- определяет порядок и способы выявления, оценки, мониторинга, контроля и (или) минимизации операционного риска;
- предпринимает иные меры по управлению операционным риском Биржи, предусмотренные настоящими Правилами.

4.1.2. Операционный риск возникает в результате:

- не оптимально выстроенных, недостаточных и/или неэффективных контрольных процедур в системах и процессах;
- неадекватных действий сотрудников (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;
- сбоев в функционировании систем и оборудования;
- неблагоприятных внешних обстоятельств, находящихся вне контроля компании (включая внешнее мошенничество, техногенные и природные катастрофы).

4.1.3. 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 и товарном рынках в целом;
- анализ подверженности операционному риску направлений деятельности Биржи;
- анализ внутренних процедур и бизнес-процессов;
- анализ внутренних структурных изменений;
- анализ отдельных операций.

4.1.4. Одним из механизмов выявления (идентификации) операционных рисков является регулярное проведение экспертной оценки сотрудниками структурных подразделений Биржи своих процессов и видов деятельности с точки зрения потенциальной уязвимости по отношению к операционным рискам (далее – Самооценка).

4.1.5. 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 сотрудников при исполнении своих должностных обязанностей в рамках этих бизнес-процессов;
- оценка эффективности существующих контрольных процедур.

4.1.6. 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.
- 4.1.7. Результаты самооценки отражаются в регулярной отчетности и доводятся до сведения органов управления Биржи в установленном настоящими Правилами порядке.
- 4.1.8. 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.
- 4.1.9. 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).
- 4.1.10. Порядок и периодичность проведения нагрузочного тестирования и тестирования отказоустойчивости определены в п. 14 настоящих Правил.
- 4.1.11. 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 Публичного акционерного общества «Санкт-Петербургская биржа» (далее - План ОНВД), в частности в него входят:
- деятельность по проведению организованных торгов на рынке ценных бумаг;
 - деятельность по проведению организованных торгов товарами.
- 4.1.12. 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:
- «Перспективная торгово-клиринговая система» (далее – ПТКС) - программа для ЭВМ, обеспечивающая возможность организации и проведения организованных торгов ценными бумагами;
 - «Биржевая компьютерная система» (далее - БКС) - программа для ЭВМ, обеспечивающая возможность организации и проведения организованных торгов товарам;
 - Серверы, иное оборудование, используемые для функционирования ПТКС и БКС.
- 4.1.13. 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 п. 13.3 настоящих Правил, и дает рекомендации по устранению недостатков в работе средств проведения торгов, а также, в случае необходимости, рекомендации по улучшению (обновлению) программно-технических средств.
- 4.1.14. 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.

- 4.1.15. 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. Участники торгов вправе при организации подключения к средствам проведения торгов проводить консультации со специалистами Биржи, обеспечивающими техническую поддержку участников торгов Биржи.
- 4.1.16. 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. Сотрудники, 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.
- 4.1.17. Вместе с тем 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.

4.2. Риск потери деловой репутации.

4.2.1. 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) сотрудниками своих должностных обязанностей;
- мошеннические действия персонала – совершение сотрудниками 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 сотрудниках, учредителях, членах органов управления, аффилированных лицах, дочерних и зависимых организациях в средствах массовой информации.

4.2.2. 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.

- 4.2.3. Структурным подразделением, осуществляющим мониторинг публикаций о Бирже во внешних источниках информации является подразделение, в функционал которого входит осуществление связей со средствами массовой информации.
- 4.2.4. Полученные сведения о потенциальных фактах риска потери деловой репутации проверяются на достоверность и значимость.
- 4.2.5. Проверка на достоверность предполагает подтверждение сведений перекрестной информацией из другого источника.
- 4.2.6. 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.
- 4.2.7. 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.
- 4.2.8. 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.

4.3. Стратегический риск.

- 4.3.1. 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.
- 4.3.2. В рамках управления стратегическим риском ДепУР осуществляет 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.

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

4.4.1. 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 сотрудников Биржи, строит отношения с клиентами на принципах равноправия клиентов, добросовестности и полноты раскрытия необходимой информации.

4.4.2. 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 сотрудниками подразделений Биржи;

- разделение служебных обязанностей сотрудников 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 сотрудникам Биржи, которым в соответствии со своими должностными обязанностями должен быть предоставлен в установленном порядке доступ к работе с такой информацией;

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

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

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

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

4.4.3. 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.

4.5. Рыночный риск.

- 4.5.1. Рыночный риск возникает в результате наличия отрицательной переоценки рыночной стоимости финансовых инструментов или активов, в которые инвестированы средства Биржи.
- 4.5.2. В целях снижения рыночного риска Биржа:
- ограничивает список инструментов, в которые можно инвестировать средства Биржи;
 - устанавливает перечень инструментов, в которые возможно инвестировать средства Биржи;
 - на регулярной основе проводит мониторинг стоимости инвестиционного портфеля Биржи.

4.6. Кредитный риск

- 4.6.1. Источником кредитного риска является возможное неисполнение одним или несколькими контрагентами своих обязательств перед Биржей в процессе осуществления Биржей инвестиционной деятельности.
- 4.6.2. В целях ограничения кредитного риска Биржа:
- проводит предварительный комплексный анализ финансового положения контрагентов;
 - 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;

4.7. Анализ рисков, проведение оценки рисков и определение метода воздействия на риски

- 4.7.1. Биржа проводит анализ рисков, предусматривающий определение метода их измерения по количественным и качественным критериям оценки рисков.
- 4.7.2. Биржа применяет различные методы оценки рисков, в том числе следующие:
- метод прямой оценки;
 - оценку по ключевым индикаторам;
 - метод экспертной оценки.
- 4.7.3. В общем случае анализ рисков и оценка уровня риска происходит исходя из вероятности их наступления и возможных финансовых последствий для деятельности Биржи. Оценка рисков Биржи проводится в соответствии с внутренними нормативными документами. Результаты оценки рисков доводятся до сведения органов управления Биржи путем их отражения в регулярной отчетности, указанной в п. 13.3 настоящих Правил.
- 4.7.4. Решением органов управления Биржи могут быть приняты меры воздействия на риск. Биржей может быть принято решение, направленное на отказ от риска, его снижение, принятие или увеличение.
- 4.7.5. Текущая оценка рисков сопоставляется с установленными Ограничениями рисков Биржи. В случае превышения допустимого уровня рисков, Биржа признает такие риски (за исключением операционного риска) значимыми.
- 4.7.6. 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.

4.7.7. Информация об исполнении Плана мероприятий также доводится до сведения органов управления Биржи в регулярной отчетности Биржи, указанной в п. 13.3 к настоящим Правилам.

4.8. Мониторинг и контроль рисков.

4.8.1. В целях обеспечения условий для эффективного мониторинга и контроля рисков событий Биржей ведется аналитическая база данных (далее – АБД), в которой содержится информация обо всех рисковом событиях Биржи, в том числе и о событиях операционного риска, и включаются следующие сведения:

- вид риска;
- дату реализации рисковом события Биржи, которое привело или может привести к возникновению расходов (убытков) Биржи;
- описание рисковом события;
- обстоятельства возникновения (выявления) рисковом события Биржи;
- размер расходов (убытков), понесенных Биржей вследствие реализации рисковом события;
- меры, принятые Биржей для устранения выявленных нарушений;
- рекомендации ДепУР для снижения рисков;
- указание на существенность рисковом события.

4.8.2. В отношении событий операционного риска АБД содержит информацию о существенности каждого события операционного риска согласно следующим критериям:

- события, влекущие за собой приостановление или прекращение осуществления процессов Биржи, приостановление или прекращение которых вызывает нарушение порядка осуществления Биржей деятельности по организации торгов, в том числе приостановление или прекращение организованных торгов, как в отношении отдельного финансового инструмента, иностранной валюты, товара, так и в отношении всех указанных инструментов (Критически важные процессы Биржи), в том числе чрезвычайные события (далее – существенные события операционного риска);

- события операционного риска, не относящиеся к существенным событиям операционного риска, но по оценке Биржи оказывающие негативное влияние на порядок и условия осуществления критически важных процессов Биржи, в том числе на подачу заявок, возможность заключения договоров на организованных торгах в отношении более чем пятнадцати процентов участников торгов или их клиентов от общего числа зарегистрированных на соответствующей торговой (биржевой) секции участников торгов или их клиентов соответственно (далее – значимые события операционного риска);

- события операционного риска, не относящиеся к существенным событиям операционного риска и значимым событиям операционного риска.

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

4.8.4. Полученная в процессе мониторинга риска информация об изменении уровня риска доводится до сведения органов управления Биржи, структурных подразделений и сотрудников Биржи, на деятельности которых может отразиться изменение уровня риска.

4.8.5. В целях контроля за рисками Биржа устанавливает Ограничения рисков и проводит мониторинг соответствия выявленных рисков Ограничениям рисков. Биржа на регулярной основе формирует отчетность, представляемую органам управления Биржи с

периодичностью и в сроки, указанные в п. 13.3 настоящих Правил, отражающую информацию о текущем состоянии рисков.

- 4.8.6. В целях обеспечения документальной фиксации информации о рисках и результатах ее оценки Биржа ведет Реестр рисков Биржи (далее - Реестр рисков).
- 4.8.7. Биржа поддерживает Реестр рисков в актуальном состоянии. В случае выявления в Реестре рисков неактуальных сведений, Биржа осуществляет пересмотр Реестра рисков Биржи.

- 5. Порядок действий Биржи, связанный с управлением рисками при оказании поставщиками услуг внешних услуг в течение всего периода их оказания, а также в случае отказа поставщика услуг от исполнения своих обязательств.**
- 5.1. К организациям, от которых зависят Критически важные процессы в силу существующих договоров на оказание услуг, относятся:
- 5.2. **Ассоциация «НП РТС»** - организация, предоставляющая право использования программного обеспечения для проведения организованных торгов ценными бумагами, право использования оборудования (серверов), используемого для функционирования программного обеспечения для проведения организованных торгов ценными бумагами и товарами, а также оказывающая услуги по сопровождению (техническому обслуживанию) оборудования (серверов), используемого для функционирования указанного программного обеспечения, направленные на обеспечение их бесперебойной работы.
- 5.3. **АО «Матчинг Солюшенс»** - 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.
- 5.4. **АО «Клиринговый центр МФБ»** - организация, предоставляющая право использования программного обеспечения для проведения организованных торгов товарами, а также оказывающая услуги по техническому обслуживанию программного обеспечения для проведения организованных торгов товарами, направленные на обеспечение его бесперебойной работы.
- 5.5. 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 сотрудников Биржи.
- 5.6. В случае необходимости проводится экстренное заседание Правления Биржи либо Совета директоров Биржи для определения нового поставщика услуг, предлагающего аналогичный сервис.
- 5.7. В случае отсутствия альтернативного поставщика услуг либо недостаточности ресурсов для восстановления сервиса приоритет при восстановлении отдается Критически важным процессам.

6. Меры, предпринимаемые Биржей для обеспечения конфиденциальности и защиты информации о рисках Биржи, а также информации, предоставляемой Биржей поставщику услуг.

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

6.2. Для обеспечения конфиденциальности информации о рисках, в том числе конфиденциальности отчетов о рисках ДепУР устанавливается следующий порядок предоставления информации и отчетности по вопросам управления рисками сотрудникам Биржи, Совету директоров и органам управления Биржи:

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

- Если иное не определено во внутренних документах Биржи:

- сроки информирования сотрудников 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 сотрудниками Биржи ДепУР определяется в соответствующем запросе ДепУР;

- органам управления Биржи ДепУР предоставляется полная и своевременная информация, в том числе отчетность по рискам, в соответствии со сроками и порядком, определённым в настоящих Правилах.

6.3. Для обеспечения конфиденциальности и защиты информации, предоставляемой Биржей поставщику услуг, Биржа предпринимает следующие действия:

6.4. Организационные меры:

- в договорах на оказание поставщиком услуг Бирже в обязательном порядке устанавливаются требования к конфиденциальности информации;

- 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 сотрудники Биржи, которым в соответствии с выполняемыми служебными обязанностями необходима работа с такой техникой (оборудованием).

6.5. Технические меры:

6.5.1. 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 сотрудникам Биржи и препятствовать несанкционированному доступу со стороны иных сотрудников и посторонних лиц.

7. Порядок разработки и утверждения Плана ОНВД

7.1. На случай возникновения нестандартных и чрезвычайных ситуаций Биржа разрабатывает План ОНВД, 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.

7.2. План ОНВД 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.

7.3. План ОНВД утверждается Советом директоров Биржи.

7.4. Не реже одного раза в год проводится профилактический пересмотр (актуализация) Плана ОНВД 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 ОНВД и существующим требованиям, а также его соответствия организационной структуре, характеру и масштабам деятельности Биржи, Стратегии развития Биржи.

7.5. План ОНВД 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.

7.6. План ОНВД 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 состава, обязанностей и полномочий пользователей системы.

7.7. С целью определения возможности выполнения Плана ОНВД в случае возникновения Нештатных ситуаций Биржей с периодичностью, определенной в Плане ОНВД, проводится проверка (тестирование) Плана ОНВД с моделированием потенциальных чрезвычайных ситуаций и привлечением сотрудников Биржи.

8. Перечень обстоятельств, наступление которых может привести к приостановлению или прекращению оказания значимых услуг.

8.1. 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.

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

8.2.1. Чрезвычайные ситуации:

- пожар;
- ураган;
- захват помещения Биржи террористами;
- угроза взрыва;
- массовые беспорядки и т.д.

8.3. 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.

9. Меры по обеспечению бесперебойного функционирования программно-технических средств Биржи, используемых для осуществления деятельности по организации торгов

9.1. Меры, принимаемые для обеспечения бесперебойного функционирования комплекса технических средств и иного необходимого для работы технических средств оборудования, 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.

9.2. 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.

10. Перечень мер, направленных на функционирование резервного комплекса средств проведения торгов, функционально дублирующего основной комплекс средств проведения торгов (далее – Резервный офис).

10.1. 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.

10.2. 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 сотрудников 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.

11. Порядок распределения ответственности и полномочий между структурными подразделениями Биржи и их сотрудниками в случае реализации существенных событий операционного риска и (или) выявления чрезвычайных ситуаций

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

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

11.3. 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 сотрудников Биржи, выполнение функций которых необходимо для поддержания деятельности Биржи.

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

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

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

12. Меры, принимаемые Биржей по защите информации и документов, связанных с проведением организованных торгов

12.1. 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 Отдела 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 сотрудников;
- меры по поддержанию адекватного информационного обеспечения, оценку готовности к чрезвычайной ситуации внешних поставщиков информационных услуг.

12.2. 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.

12.3. 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.

12.4. 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, .

12.5. 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.

12.6. Ответственность за защиту и контроль доступа к информации несет Отдел информационной безопасности Биржи.

13. Проверка эффективности управления рисками и отчетность по рискам.

13.1. При проверке эффективности управления рисками осуществляются следующие мероприятия:

- рассмотрение и расследование фактов возникновения убытков, нарушений, а так же превышения Ограничений рисков и причин их возникновения – по факту возникновения убытков;
- применение административных мер к сотрудникам Биржи, виновным в возникновении убытков, нарушений, а так же превышения Ограничений рисков – по завершении расследования по соответствующему факту;
- периодическая оценка результатов указанных расследований, а также оценка достигнутого уровня управления риском органами управления Биржей – ежеквартально;
- периодическое представление органам управления Биржи отчетов о Рисках – в соответствии с п. 13.3 настоящих Правил.

13.2. В целях контроля за эффективностью управления рисками основные принципы управления рисками пересматриваются по мере необходимости на основе анализа:

- достигнутого уровня управления рисками Биржи;
- международного опыта и опыта российских организаций в области управления Рисками;
- изменений, происходящих на финансовом и товарном рынках;
- других внешних и внутренних факторов, которые могут оказать влияние на показатели деятельности Биржи.

13.3. Директор ДепУР осуществляет формирование следующих отчетов о Рисках Биржи:

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

13.4. Ежеквартальный отчет о состоянии управления рисками состоит из аналитической части, в которой интерпретируются полученные результаты и даются рекомендации в отношении мероприятий по управлению рисками, 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 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 предоставляется на рассмотрение Совету директоров Биржи, Правлению Биржи и Генеральному директору Биржи не позднее 30 (тридцати) дней с даты окончания очередного квартала.

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

13.6. Отчет о нарушении содержит:

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

13.7. Отчет о нарушении предоставляется 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.

14. Порядок и периодичность проведения стресс-тестирования программно-технических средств, а также требования к сценариям, используемым для такого тестирования.

14.1. 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).

14.2. Стресс-тестирование состоит из следующих компонентов:

- нагрузочное тестирование;
- тестирование отказоустойчивости.

14.3. 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.

14.4. 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.

14.5. 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).

• Отчет о проведении стресс-тестирования составляется ответственным за проведение стресс-тестирования сотрудником и предоставляется Генеральному директору Биржи. В случае выявления недостатков в работе средств проведения торгов, выявленных в результате стресс-тестирования, в отчете отражаются рекомендации по устранению выявленных недостатков. Генеральный директор Биржи после получения отчета о стресс-тестировании с указанными недостатками организует мероприятия по их устранению. Информация об исполнении мероприятий отражается в Ежеквартальном отчете о состоянии управления рисками за прошедший квартал.

15. Заключительные положения

- 15.1 Требования настоящих Правил подлежат обязательному исполнению сотрудниками всех подразделений Биржи.
- 15.2 Сотрудники ДепУР вправе требовать у сотрудников и должностных лиц Биржи предоставления информации (документов), в том числе письменных объяснений, по вопросам, возникающим в ходе выполнения им своих обязанностей.
- 15.3 Лица, нарушающие или не исполняющие требования настоящих Правил, привлекаются к дисциплинарной или административной в соответствии с законодательством Российской Федерации.
- 15.4 Руководители структурных подразделений Биржи несут персональную ответственность за исполнение обязанностей их подчиненными.
- 15.5 Настоящие Правила утверждаются Советом директоров Биржи и подлежат регистрации в установленном Федеральным законом «Об организованных торгах» порядке.
- 15.6 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.