

СЛУЖБА БАНКА РОССИИ  
ПО ФИНАНСОВЫМ РЫНКАМ

**ЗАРЕГИСТРИРОВАНО**

Дата "06" декабря 2013 г.  
в реестре за № 13-695/13-4

Заместитель руководителя *С.К. Филиппов*  
Подпись \_\_\_\_\_



УТВЕРЖДЕНО  
решением Биржевого Совета  
закрытого акционерного общества  
«Санкт - Петербургская Валютная Биржа»  
26 сентября 2013 г. (Протокол №254)

Управляющий  
закрытого акционерного общества  
«Санкт - Петербургская Валютная Биржа»

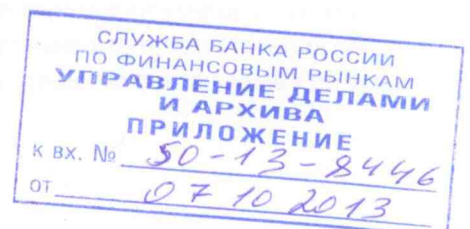


*[Signature]*  
/А.Ю.Филаретов/

ПРАВИЛА УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ, СВЯЗАННЫМИ С  
ОСУЩЕСТВЛЕНИЕМ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ ОРГАНИЗАТОРА ТОРГОВЛИ,  
ЗАКРЫТЫМ АКЦИОНЕРНЫМ ОБЩЕСТВОМ  
«САНКТ-ПЕТЕРБУРГСКАЯ ВАЛЮТНАЯ БИРЖА»

г. Санкт-Петербург

2013 г.



## ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

- 1.1. Правила управления рисками, связанными с осуществлением деятельности организатора торговли закрытым акционерным обществом «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» (далее – Правила управления рисками), разработаны в соответствии с требованиями:
  - Федерального закона от 21.11.2011 N 325-ФЗ «Об организованных торгах»,
  - принятых в соответствии с ним нормативных правовых актов Банка России,
  - Приказа Федеральной службы по финансовым рынкам (ФСФР России) от 25 июня 2013 г. N 13-53/пз-н "Об утверждении требований к деятельности организатора торговли в части организации системы управления рисками и порядка осуществления внутреннего контроля, а также к отдельным внутренним документам организатора торговли",
  - Устава и внутренних нормативных документов закрытого акционерного общества «Санкт-Петербургская Валютная Биржа» (далее – СПВБ), связанных с деятельностью по организации торговли.
- 1.2. Правила управления рисками определяют принципы, элементы системы, методы управления рисками, порядок мониторинга и контроля за эффективностью системы управления рисками, и органы, ответственные за ее функционирование, и раскрытие информации о ней.
- 1.3. Правила управления рисками утверждаются Биржевым Советом СПВБ.
- 1.4. Меры, направленные на предотвращение конфликта интересов при осуществлении СПВБ профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, определены в документе «Перечень мер, направленных на предотвращение конфликта интересов при проведении организованных торгов».
- 1.5. Меры, принимаемые СПВБ в чрезвычайных ситуациях и направленные на обеспечение непрерывности осуществления деятельности СПВБ по организации торгов, определены в документе «План обеспечения непрерывности и восстановления деятельности».

## 1. ОСНОВНЫЕ ОПРЕДЕЛЕНИЯ

- 2.1. Основные термины, используемые в Правилах управления рисками:
  - 2.1.1. *Риск* – влияние неопределенности на цели организации.
  - 2.1.2. *Управление рисками (риск-менеджмент)* – скоординированные действия по управлению организацией с учетом риска.
  - 2.1.3. *Система управления рисками (система риск-менеджмента)* – набор компонентов, обеспечивающих основы и организационную структуру для разработки, внедрения, мониторинга, пересмотра и постоянного улучшения риск-менеджмента в масштабе всей организации.
  - 2.1.4. *Операционный риск СПВБ* – риск возникновения расходов (убытков) СПВБ в связи с осуществлением им деятельности, предусмотренной Федеральным законом «Об организованных торгах», в результате нарушения нормальной работы структурных подразделений СПВБ, штатной работы программно-технических средств СПВБ, правил и требований к совершению СПВБ операций, в том числе по причине ошибок, недобросовестных или умышленных действий сотрудников СПВБ, технических сбоев, а также влияния внешних обстоятельств.
  - 2.1.5. *Регуляторный риск СПВБ* – риск возникновения расходов (убытков) СПВБ в результате несоответствия СПВБ, а также осуществляемой им деятельности требованиям Федерального закона «Об организованных торгах» и принятых в соответствии с ним нормативных правовых актов Банка России, а также устава и внутренних документов СПВБ, связанных с деятельностью СПВБ.
  - 2.1.6. *Риск потери деловой репутации СПВБ* – риск возникновения расходов (убытков) СПВБ в результате уменьшения числа участников торгов или уменьшения объема торгов вследствие формирования в обществе негативного представления об операционной (технической) устойчивости СПВБ, качестве оказываемых ей услуг или характере деятельности в целом.

- 2.1.7. *Стратегический риск СПВБ* – риск возникновения расходов (убытков) СПВБ в результате ошибок (недостатков), допущенных при принятии решений, определяющих стратегию деятельности и развития СПВБ.
- 2.1.8. *Регулятор* – Служба Банка России по финансовым рынкам (далее – Банк России), осуществляющая принятие нормативных правовых актов, контроль и надзор в сфере финансовых рынков.
- 2.1.9. *Реестр рисков* – список выявленных (идентифицированных рисков) СПВБ.
- 2.1.10. *План управления рисками* – документ, описывающий меры по управлению рисками СПВБ.

## 2. ПОЛИТИКА УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

- 3.1. Политика СПВБ в области управления рисками (принципы, цели, задачи и организационная структура) определяется Биржевым Советом СПВБ.
- 3.2. СПВБ рассматривает управление рисками как один из важнейших элементов стратегического управления и внутреннего контроля. Это процесс, в ходе которого СПВБ регулярно выявляет, оценивает и контролирует угрозы и возможности, адаптирует свою деятельность с целью уменьшения вероятности и потенциальных последствий угроз и с целью реализации возможностей, а также информирует об этом акционеров и иных заинтересованных лиц.
- 3.3. В рамках своей политики управления рисками СПВБ учитывает не только интересы акционеров, но и возможные последствия своей деятельности для других заинтересованных сторон.
- 3.4. Система управления рисками СПВБ направлена не на устранение рисков, а на повышение вероятности достижения стратегических целей и снижение вероятности и размера возможных потерь. Для этого СПВБ устанавливает уровни приемлемого риска для каждой категории существенных рисков.
- 3.5. Система управления рисками СПВБ призвана:
  - 3.5.1. обеспечить выполнение требований регулятора к деятельности СПВБ в части организации системы управления рисками;
  - 3.5.2. обеспечить выполнение требований надлежащей практики корпоративного управления, в соответствии с которыми СПВБ должна обращать особое внимание на учет, мониторинг рисков, управление ими и должное раскрытие информации в этой области;
  - 3.5.3. предупреждать ситуации, угрожающие стратегическим целям СПВБ, и обеспечивать соответствующую защиту;
  - 3.5.4. обеспечить координацию и интеграцию процессов управления рисками, относящихся к различным аспектам финансово-хозяйственной деятельности, в целях общего повышения эффективности управления СПВБ;
  - 3.5.5. обеспечить использование новых возможностей для увеличения стоимости активов и прибыльности СПВБ в долгосрочной перспективе.
- 3.6. В целях эффективного контроля со стороны Биржевого Совета СПВБ за системой управления рисками создан Комитет Биржевого Совета ЗАО СПВБ по рискам и аудиту (далее — Комитет по рискам), действующий на постоянной основе.
- 3.7. К задачам Комитета по рискам относятся:
  - 3.7.1. оценка эффективности и совершенствование системы управления рисками СПВБ, связанной с организацией торгов, а также с осуществлением операций с собственным имуществом;
  - 3.7.2. оценка эффективности и совершенствование системы управления рисками СПВБ как клиринговой организации;
  - 3.7.3. оценка возможного влияния планов развития деятельности СПВБ на существующие риски и на возникновение новых рисков;
  - 3.7.4. оценка кандидатов в аудиторы и представление результатов такой оценки Биржевому Совету СПВБ;

