

Предложения и замечания к проекту Указания

| № п/п | Текст проекта Указания | Предложения/ замечания |
|----------|---|--|
| 1 | <p>П.1.1 «Профессиональный участник в соответствии с требованиями настоящего Указания должен организовать систему управления рисками, содержащую систему мониторинга рисков профессионального участника и обеспечивающую в порядке, предусмотренном во внутреннем (внутренних) документе (документах) профессионального участника, устанавливающим (устанавливающих) порядок организации и осуществления управления рисками профессионального участника...».</p> | <p>«Профессиональный участник в соответствии с требованиями настоящего Указания должен организовать систему управления рисками, содержащую <u>систематические проверки, надзор, обследования и определение состояния рисков (мониторинг)</u> профессионального участника и обеспечивающую в порядке, предусмотренном во внутреннем (внутренних) документе (документах) профессионального участника, устанавливающим (устанавливающих) порядок организации и осуществления управления рисками профессионального участника...».</p> |
| 2 | <p>П. 1.3 «Профессиональный участник в рамках системы управления рисками должен назначить должностное лицо или сформировать отдельное структурное подразделение, ответственное за организацию системы управления рисками, за исключением риска возникновения у профессионального участника расходов (убытков) и (или) иных неблагоприятных последствий в результате его несоответствия или несоответствия его деятельности требованиям законодательства Российской Федерации о рынке ценных бумаг, базовых и внутренних стандартов саморегулируемой организации в сфере финансового рынка, членом которой является профессиональный участник, учредительных и внутренних документов профессионального участника, связанных с осуществлением профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, а также в результате применения мер воздействия со стороны надзорных органов (далее – регуляторный риск), <u>управление которым осуществляется контролером (службой внутреннего контроля) профессионального участника</u>».</p> | <p>«Профессиональный участник в рамках системы управления рисками должен назначить должностное лицо или сформировать отдельное структурное подразделение, ответственное за организацию системы управления рисками, в том числе риска возникновения у профессионального участника расходов (убытков) и (или) иных неблагоприятных последствий в результате его несоответствия или несоответствия его деятельности требованиям законодательства Российской Федерации о рынке ценных бумаг, базовых и внутренних стандартов саморегулируемой организации в сфере финансового рынка, членом которой является профессиональный участник, учредительных и внутренних документов профессионального участника, связанных с осуществлением профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, а также в результате применения мер воздействия со стороны надзорных органов (далее – регуляторный риск).</p> <p><u>Ответственность за реализацию регуляторного риска, а также за нарушение установленного предельного размера (допустимого уровня) регуляторного риска возлагается на контролера</u></p> |

| | | |
|---|---|---|
| | | (службу внутреннего контроля профессионального участника). |
| 3 | П. 1.4 «В рамках организации системы управления рисками профессиональный участник по своему усмотрению может привлекать третьих лиц для обеспечения процессов и мероприятий, предусмотренных главой 2 настоящего Указания (за исключением процессов по <u>минимизации</u> этих рисков профессионального участника или их исключению, а также обмену информацией о рисках профессионального участника), при обеспечении в указанном случае соблюдения профессиональным участником требований настоящего Указания». | «В рамках организации системы управления рисками профессиональный участник по своему усмотрению может привлекать третьих лиц для обеспечения процессов и мероприятий, предусмотренных главой 2 настоящего Указания (за исключением процессов по <u>снижению</u> этих рисков профессионального участника или их исключению, а также обмену информацией о рисках профессионального участника), при обеспечении в указанном случае соблюдения профессиональным участником требований настоящего Указания». |
| 4 | П. 1.5 «В случае совмещения профессиональным участником своей деятельности с иными видами деятельности, система управления рисками должна обеспечивать управление рисками профессионального участника, связанными с профессиональной деятельностью на рынке ценных бумаг, с учетом рисков неисполнения обязательств перед <u>клиентами</u> профессионального участника, возникающих в результате такого совмещения деятельности (при наличии)». | «В случае совмещения профессиональным участником своей деятельности с иными видами деятельности, система управления рисками должна обеспечивать управление рисками профессионального участника, связанными с профессиональной деятельностью на рынке ценных бумаг, с учетом рисков неисполнения обязательств перед <u>его клиентами на финансовом рынке</u> , возникающих в результате такого совмещения деятельности (при наличии)». |
| 5 | П. 1.6 «Система управления рисками должна обеспечивать управление рисками профессионального участника, а также рисками клиентов профессионального участника, которые возникают в связи с оказанием им услуг и с осуществлением операций с собственным имуществом профессионального участника. При управлении рисками своих клиентов профессиональный участник должен осуществлять мероприятия по их <u>минимизации</u> ». | «В случае, если профессиональный участник рынка ценных бумаг распоряжается имуществом клиента, в том числе на основании поручения клиента, система управления рисками должна обеспечивать управление рисками профессионального участника, а также рисками клиентов профессионального участника. При управлении рисками своих клиентов профессиональный участник должен осуществлять мероприятия по их <u>снижению</u> ». |
| 6 | П. 2.1 «Профессиональный участник в рамках организации системы управления рисками должен обеспечить на постоянной основе осуществление следующих процессов: выявление рисков профессионального участника; анализ и <u>сравнительная</u> оценка рисков профессионального участника; | «Профессиональный участник в рамках организации системы управления рисками должен обеспечить на постоянной основе осуществление следующих процессов: выявление рисков профессионального участника; анализ и оценка рисков профессионального участника; |

| | | |
|----|---|---|
| | <p>мониторинг, <u>измерение</u> и контроль рисков профессионального участника, <u>минимизация</u> рисков профессионального участника или их исключение;</p> <p>обмен информацией о рисках профессионального участника».</p> | <p>мониторинг и контроль рисков профессионального участника, <u>снижение</u> рисков профессионального участника или их исключение...».</p> |
| 7 | <p>П.2.2.1 «Выявление рисков, в том числе следующих видов рисков: ...</p> <p>риск утраты <u>имущества</u> профессионального участника или <u>имущества</u> его клиентов, вследствие действий или бездействия лица, ответственного за хранение <u>этого имущества</u> и учет прав на <u>это имущество</u> (далее - кастодиальный риск)».</p> | <p>«...риск утраты <u>ценных бумаг</u> профессионального участника или <u>ценных бумаг</u> его клиентов, вследствие действий или бездействия лица, ответственного за хранение данных <u>ценных бумаг</u> и учет прав на <u>них</u> (далее – кастодиальный риск)».</p> |
| 8 | <p>П. 2.3 «Профессиональный участник в рамках анализа и <u>сравнительной</u> оценки рисков профессионального участника должен обеспечить выполнение следующих мероприятий».</p> | <p>«Профессиональный участник в рамках анализа и оценки рисков профессионального участника должен обеспечить выполнение следующих мероприятий».</p> |
| 9 | <p>П. 2.3.3 «<u>Сравнение</u> выявленных рисков профессионального участника с установленными профессиональным участником критериями существенности последствий, к которым может привести реализация рисков профессионального участника, в целях признания профессиональным участником их значимыми».</p> | <p>«<u>Сопоставление результатов</u> оценки рисков профессионального участника с установленными профессиональным участником критериями существенности последствий, к которым может привести реализация <u>соответствующих</u> рисков профессионального участника, в целях признания профессиональным участником их значимыми».</p> |
| 10 | <p>П. 2.3.4 «Установление <u>ограничений</u> рисков профессионального участника, в том числе совокупного предельного размера рисков профессионального участника (далее – ограничения рисков), в соответствии с методикой определения ограничений рисков, предусмотренной регламентом управления рисками профессионального участника».</p> | <p>«Установление <u>предельного размера</u> рисков (<u>допустимого уровня рисков</u>) профессионального участника, <u>а также</u> совокупного предельного размера рисков профессионального участника (далее – ограничения рисков), в соответствии с методикой <u>их</u> определения, предусмотренной регламентом управления рисками профессионального участника».</p> |
| 11 | <p>П. 2.4 «Профессиональный участник в рамках мониторинга, <u>измерения</u> и контроля рисков профессионального участника, <u>минимизации</u> рисков профессионального участника или их исключения, должен обеспечить выполнение</p> | <p>«Профессиональный участник в рамках мониторинга и контроля рисков профессионального участника, в целях <u>снижения</u> рисков профессионального участника или их исключения, должен обеспечить выполнение</p> |

| | следующих мероприятий». | следующих мероприятий». |
|----|--|---|
| 12 | <p>П. 2.4.3 «Разработка и реализация мероприятий по устранению выявленных нарушений ограничений рисков и (или) иных мероприятий в отношении рисков профессионального участника в рамках <u>минимизации</u> этих рисков профессионального участника или их исключения в порядке, предусмотренном регламентом управления рисками профессионального участника.</p> <p>Профессиональный участник должен обеспечить в отношении рисков профессионального участника, включенных в реестр рисков профессионального участника, разработку внутреннего (внутренних) документа (документов), содержащего (содержащих) мероприятия, <u>по минимизации</u> этих рисков профессионального участника и их исключению (далее – план мероприятий), обязательное доведение плана мероприятий до сведения органов управления профессионального участника в порядке и сроки, предусмотренные регламентом управления рисками профессионального участника, и осуществление исполнения плана мероприятий».</p> | <p>«Разработка и реализация мероприятий по устранению выявленных нарушений ограничений рисков и (или) иных мероприятий в отношении рисков профессионального участника в рамках <u>снижения</u> этих рисков профессионального участника или их исключения в порядке, предусмотренном регламентом управления рисками профессионального участника.</p> <p>Профессиональный участник должен обеспечить в отношении рисков профессионального участника, включенных в реестр рисков профессионального участника, разработку внутреннего (внутренних) документа (документов), содержащего (содержащих) мероприятия, <u>по снижению</u> этих рисков профессионального участника и их исключению (далее – план мероприятий), обязательное доведение плана мероприятий до сведения органов управления профессионального участника в порядке и сроки, предусмотренные регламентом управления рисками профессионального участника, и осуществление исполнения плана мероприятий».</p> |
| 13 | <p>П. 2.4.4 «Оценка эффективности порядка выявления нарушений ограничений рисков и порядка их устранения и (или) осуществления иных мероприятий в отношении рисков профессионального участника в рамках минимизации этих рисков профессионального участника или их исключения».</p> <p>П. 2.4.5 «Оценка эффективности управления рисками профессионального участника, в том числе определение соотношения уровня рисков профессионального участника с установленными ограничениями рисков после осуществления мероприятий, предусмотренных абзацем первым подпункта 2.4.3 настоящего пункта»</p> | <p><u>«Профессиональный участник осуществляет оценку эффективности управления рисками, в том числе путем сопоставления фактических уровней рисков с установленными ограничениями рисков после осуществления мероприятий, предусмотренных абзацем первым подпункта 2.4.3 настоящего пункта.</u></p> <p><u>В рамках оценки эффективности управления рисками профессиональный участник анализирует результативность своей деятельности по выявлению нарушений ограничений рисков и их устранению и (или) осуществлению иных мероприятий в рамках снижения этих рисков профессионального участника или их исключения».</u></p> |
| 14 | <p>П. 3.1 «Регламент управления рисками профессионального участника должен включать:</p> <p>общие положения, определяющие цели организации системы управления рисками;</p> | <p>«Регламент управления рисками профессионального участника должен включать:</p> <p>общие положения, определяющие цели организации системы управления рисками;</p> <p>порядок признания профессиональным</p> |

| | |
|---|--|
| <p>порядок признания профессиональным участником рисков значимыми, <u>а также определение критериев существенности последствий, к которым может привести реализация рисков профессионального участника, в целях признания профессиональным участником таких рисков профессионального участника значимыми;</u></p> <p>методику определения ограничений рисков профессионального участника и размеры указанных ограничений рисков;</p> <p>порядок выявления нарушений ограничений рисков и порядок осуществления мероприятий по их устранению и (или) осуществления иных мероприятий в отношении рисков профессионального участника в рамках минимизации этих рисков профессионального участника или их исключения, контроля за их реализацией;</p> <p>периодичность и порядок оценки эффективности порядка выявления нарушений ограничений рисков;</p> <p>порядок организации и осуществления процессов и мероприятий, предусмотренных главой 2 настоящего Указания, в том числе принятия решений профессиональным участником в рамках управления рисками профессионального участника (по каждому виду рисков, <u>за исключением регуляторного риска</u>);</p> <p>порядок ведения на постоянной основе реестра рисков профессионального участника с указанием источников этих рисков профессионального участника (за исключением регуляторного риска), а также периодичность пересмотра реестра рисков профессионального участника в целях актуализации данных, содержащихся в нем (за исключением случая, предусмотренного абзацем вторым подпункта 2.2.2 пункта 2.2 настоящего Указания);</p> <p>права и обязанности органов управления профессионального участника, руководителей и работников структурных подразделений профессионального участника, в том числе должностного лица (руководителя отдельного структурного подразделения), ответственного за организацию системы управления рисками,</p> | <p>участником рисков значимыми;</p> <p>методику определения ограничений рисков профессионального участника и размеры указанных ограничений рисков;</p> <p>порядок выявления нарушений ограничений рисков и порядок осуществления мероприятий по их устранению и (или) осуществления иных мероприятий в отношении рисков профессионального участника в рамках снижения этих рисков профессионального участника или их исключения, контроля за их реализацией;</p> <p>порядок организации и осуществления процессов и мероприятий, предусмотренных главой 2 настоящего Указания, в том числе принятия решений профессиональным участником в рамках управления рисками профессионального участника (по каждому виду рисков);</p> <p>порядок ведения на постоянной основе реестра рисков профессионального участника с указанием источников этих рисков профессионального участника, а также периодичность пересмотра реестра рисков профессионального участника в целях актуализации данных, содержащихся в нем (за исключением случая, предусмотренного абзацем вторым подпункта 2.2.2 пункта 2.2 настоящего Указания);</p> <p>права и обязанности органов управления профессионального участника, руководителей и работников структурных подразделений профессионального участника, в том числе должностного лица (руководителя отдельного структурного подразделения), ответственного за организацию системы управления рисками, в рамках организации системы управления рисками профессионального участника;</p> <p>порядок взаимодействия органов управления профессионального участника, в том числе установление случаев и порядка обязательного информирования о рисках профессионального участника;</p> <p>порядок, содержание и периодичность представления отчетов об управлении рисками профессионального участника органам управления профессионального участника;...»</p> |
|---|--|

| | |
|---|--|
| <p>в рамках организации системы управления рисками профессионального участника;</p> <p>порядок взаимодействия органов управления профессионального участника, в том числе установление случаев и порядка обязательного информирования о рисках профессионального участника (за исключением регуляторного риска);</p> <p>порядок, содержание и периодичность представления отчетов об управлении рисками профессионального участника органам управления профессионального участника, за исключением отчетов об управлении регуляторным риском;...»</p> | |
|---|--|