

**УТВЕРЖДЕНО**

Советом Директоров РДК (ЗАО)  
Протокол № СД-7/2011 от 30.06.2011

С изменениями от:

- 22.10.2011 (Протокол № СД-11/2011)
- 10.08.2015 (Протокол № СД-9/2015)
- 25.08.2017 (Протокол № СД-8//2017)

**Положение о Комитете по риск-менеджменту  
при Совете директоров Акционерного общества «Расчетно-  
депозитарная компания»**

**Москва**

**2011 год**

Настоящее Положение о Комитете по риск-менеджменту при Совете директоров Акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания» (далее соответственно «Положение», «Комитет», «Общество») разработано в соответствии с законодательством Российской Федерации, Уставом и внутренними документами Общества и устанавливает порядок создания и деятельности Комитета, а также определяет его задачи и функции.<sup>1</sup>

## **1. Общие положения**

1.1. Комитет является постоянно действующим консультативно-совещательным органом Общества, целью деятельности которого является экспертиза системы управления рисками Общества по срочным контрактам, заключенным в Секции срочного рынка АО «СПбМТСБ», по сделкам с реальным товаром, совершаемым в иных Секциях АО «СПбМТСБ», а также выработка рекомендаций в отношении ее применения и развития.

1.2. Комитет осуществляет свою деятельность в соответствии с законодательством Российской Федерации, Уставом Общества, настоящим Положением, создается при Совете директоров Общества и подотчетен Совету директоров.

1.3. Решения Комитета носят рекомендательный и информационный характер и представляются Совету директоров и Генеральному директору Общества для решения вопросов, отнесенных к их компетенции.

1.4. Настоящее Положение, а также дополнения и изменения к нему утверждаются Советом директоров Общества.

## **2. Задачи и функции Комитета**

2.1. Основными задачами Комитета являются:

2.1.1. экспертиза системы управления рисками РДК (АО) по срочным контрактам, заключенным в Секции срочного рынка АО «СПбМТСБ» (далее – срочные контракты), а также по сделкам с реальным товаром, совершаемым в иных Секциях АО «СПбМТСБ», в том числе требований к финансовому состоянию Участников клиринга и уполномоченных Расчетных организаций;

2.1.2. экспертиза средств обеспечения исполнения обязательств по срочным контрактам и по сделкам с реальным товаром, а также требований к порядку хранения и размещения указанного обеспечения;

---

<sup>1</sup> Изменения по тексту «ЗАО» на «АО» утверждены Советом Директоров РДК (АО) (Протокол № СД-8//2017 от «25» августа 2017 года)

2.1.3. предварительное одобрение Инвестиционной декларации РДК (АО) по размещению денежных средств, составляющих Коллективный гарантийный фонд, во вклады в Расчетных организациях;

2.1.4. выработка рекомендаций в отношении значений базовых параметров Системы управления рисками;

2.1.5. экспертиза требований, предъявляемых РДК (АО) для аккредитации кредитных организаций, банковские гарантии которых принимаются в качестве обеспечения обязательств участников клиринга на товарных рынках АО «СПбМТСБ», а также экспертиза методики расчета предельных лимитов на совокупную величину гарантий по уплате гарантийных взносов, устанавливаемых РДК (АО) в отношении таких аккредитованных кредитных организаций;

2.1.6. предварительное одобрение документов, определяющих меры, направленные на снижение кредитных, операционных и иных рисков, в том числе рисков, связанных с совмещением клиринговой деятельности с иными видами деятельности, меры по обеспечению бесперебойного функционирования программно-технических средств, предназначенных для осуществления клиринговой деятельности, меры, направленные на предотвращение и урегулирование конфликта интересов при осуществлении клиринга и совмещении клиринговой деятельности с иными видами деятельности;

2.1.7. предварительное одобрение документа, определяющего порядок проведения стресс-тестирования;

2.1.8. предварительное одобрение документа, определяющего меры, принимаемые Обществом в случаях возникновения чрезвычайных обстоятельств, которые могут препятствовать нормальному осуществлению клиринговой деятельности, и направленные на обеспечение непрерывности осуществления такой деятельности;

2.1.9. иные вопросы, отнесенные к ведению Комитета решениями уполномоченных органов РДК (АО) и законодательством Российской Федерации.

### **3. Состав и порядок формирования Комитета**

3.1. Количественный состав Комитета и срок, на который избираются члены Комитета, определяются Советом директоров Общества.

3.2. Члены Комитета избираются Советом директоров Общества, по предложению членов Совета директоров и Генерального директора Общества, как правило из числа представителей Участников клиринга, штатных сотрудников Общества, штатных сотрудников АО СПбМТСБ, а также независимых экспертов.

Не менее половины состава комитета должны составлять представители Участников клиринга.

3.3. Члены Комитета должны обладать квалификацией, знаниями и опытом, необходимыми для рассмотрения вопросов, отнесенных к компетенции Комитета в соответствии с настоящим Положением.

3.4. Члены Комитета избираются на срок, определенный Советом директоров Общества.<sup>2</sup>

3.5. Лица, избранные в состав Комитета, могут переизбираться Советом директоров Общества неограниченное количество раз.

3.6. Председатель Комитета и один или несколько его заместителей избираются из числа членов Комитета Советом директоров Общества по предложению Генерального директора Общества. Председатель Комитета (а в случае его отсутствия – один из его заместителей) председательствует на заседаниях Комитета. В своей деятельности Председатель Комитета подчиняется Совету директоров Общества и руководствуется настоящим Положением<sup>3</sup> 3.7. Секретарь Комитета назначается Генеральным директором Общества из числа работников Общества. Секретарь комитета может являться членом Комитета.

3.8. По решению Совета директоров Общества полномочия отдельных членов Комитета могут быть прекращены досрочно по предложению Генерального директора Общества, а также на основании письменного заявления члена Комитета о добровольном выходе из состава Комитета, либо на основании решения Комитета о выводе из его состава отдельного члена.

3.9. Организация, представитель которой входит в состав Комитета, вправе подать заявление в Совет директоров Общества о выдвижении нового представителя в состав Комитета в случае, когда трудовые отношения прежнего члена Комитета и организации, представителем которой он является, прекратились. Решение по заявлению организации о выдвижении в состав Комитета нового представителя принимается Советом директоров Общества. Членство прежнего представителя организации в Комитете прекращается, если иное решение не было принято Советом директоров Общества по заявлению организации, выдвинувшей данное лицо в состав Комитета

3.10. Замещение вакансий в связи с прекращением членства в Комитете производится Советом директоров Общества по предложению Генерального директора Общества.

---

<sup>2</sup> Изменения п.3.4 утверждены Советом Директоров РДК (ЗАО) (Протокол № СД-9/2015 от «10» августа 2015 года)

<sup>3</sup> Изменения п.3.6 утверждены Советом Директоров РДК (ЗАО) (Протокол № СД-11/2011 от «22» декабря 2011 года)

3.11. В случае необходимости при Комитете могут создаваться подкомитеты, а также экспертные и рабочие группы. Компетенция, состав, формирование и порядок работы подкомитетов, экспертных и рабочих групп определяются соответствующими положениями, принимаемыми на заседании Комитета.

#### **4. Порядок работы Комитета**

4.1. Обсуждение вопросов и принятие решений производится на заседаниях Комитета, которые проводятся по мере необходимости.

4.2. Члены Комитета своевременно (не менее чем за три рабочих дня до предлагаемой даты проведения заседания Комитета) извещаются о дате, времени, месте проведения и повестке дня заседания Комитета.

4.3. Повестка дня заседания Комитета формируется Председателем Комитета из вопросов, выносимых на заседание Комитета, и утверждается решением Комитета в начале заседания. Материалы по вопросам повестки дня заседания Комитета рассылаются членам Комитета по электронной почте не позднее, чем за три рабочих дня до даты заседания Комитета.

4.4. Комитет правомочен принимать решения, если на его заседании присутствует не менее половины от общего числа его членов.

4.5. Каждый из членов Комитета, включая Председателя, обладает одним голосом.

4.6. Решения Комитета принимаются простым большинством голосов от числа присутствующих на заседании. При равенстве голосов голос Председателя Комитета является решающим.

4.7. Член Комитета, в случае невозможности личного присутствия на заседании Комитета, имеет право назначить своего представителя, полномочия которого должны быть подтверждены надлежащим образом оформленной доверенностью, и/или представлять письменное мнение по вопросам повестки дня.<sup>4</sup>

4.8. Для участия в заседании Комитета с правом совещательного голоса могут быть приглашены в качестве экспертов или консультантов, в том числе, представители государственных органов, Участников клиринга, штатные сотрудники Общества, штатные сотрудники АО «СПбМТСБ» и независимые эксперты.

4.9. Принятые Комитетом решения оформляются протоколом заседания Комитета, который составляется в двух экземплярах Секретарем Комитета не позднее 10 дней после его

---

<sup>4</sup> Изменения п.4.7 утверждены Советом Директоров РДК (АО) (Протокол № СД-8//2017 от «25» августа 2017 года)

проведения. Протокол заседания подписывается Председателем Комитета и Секретарем Комитета.

4.10. В протоколе заседания Комитета указываются:

- место и время проведения заседания Комитета;
- перечень лиц, присутствующих на заседании;
- повестка дня заседания;
- вопросы, поставленные на голосование, и итоги голосования по ним;
- принятые решения.

4.11. Протоколы и материалы к заседанию Комитета хранятся у Секретаря Комитета.

4.13. Копии протоколов заседаний Комитета или выписки из них могут направляться в структурные подразделения Общества, а также иным заинтересованным юридическим и физическим лицам по указанию Генерального директора Общества.

4.14. Решения Комитета доводятся до сведения лиц, которых соответствующие решения затрагивают, а также иных лиц в соответствии с решением Комитета.

4.15. В случае необходимости, по решению Председателя Комитета, допускается проведение голосования в заочной форме. Для этого вопрос, вынесенный на голосование, должен быть изложен в письменной форме и направлен (не менее чем за три рабочих дня до завершения срока голосования) по факсимильной связи и электронной почте членам Комитета с указанием срока для голосования. Постановка вопроса должна предполагать однозначный и определенный ответ. Бюллетени заочного голосования членов Комитета должны быть направлены на имя Председателя Комитета по факсимильной связи не позднее установленного срока для голосования, с последующим представлением оригинала бюллетеня.

4.16. При необходимости, по решению Председателя Комитета или Клиринговой организации может быть установлен иной порядок проведения отдельных заседаний Комитета.

## **5. Ответственность членов Комитета**

5.1. Члены Комитета должны осуществлять свои права и исполнять обязанности в отношении Общества добросовестно и разумно, не нанося ущерба интересам Общества, а также его деловой репутации.

5.2. Члены Комитета обязаны соблюдать конфиденциальность информации, которая им была предоставлена в связи с выполнением их функций и выполнять требования внутренних документов Общества, определяющих порядок работы со сведениями,

составляющими конфиденциальную информацию Общества. С каждым членом Комитета могут быть заключены соглашения о конфиденциальности.

5.3. Члены Комитета несут ответственность перед Обществом за убытки, причиненные Обществу их виновными действиями (бездействием), если иные основания и размер ответственности не установлены законодательством Российской Федерации.