«Утверждено»

1 сентября 2020 года

Председатель Попечительского

Совета Фонда РФИ

«Инфраструктурный институт»

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ П.М. Лансков

Методика определения совокупной взвешенной оценки (рейтинга) деятельности специализированных депозитариев

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| № | Показатель | Критерий | Баллы |
|  | Опыт работы (продолжительность деятельности) организации в качестве специализированного депозитария | опыт работы (продолжительность деятельности) организации в качестве специализированного депозитария (по дате получения лицензии): | 5 |
|  | Объём контролируемого специализированным депозитарием имущества | суммарный объём контролируемого специализированным депозитарием имущества: | 6 |
|  | Количество обслуживаемых специализированным депозитарием портфелей | количество обслуживаемых специализированным депозитарием портфелей | 6 |
|  | Диверсификация деятельности специализированного депозитария | по видам объектов контроля со стороны специализированного депозитария (АИФ, ПИФ, НПФ – пенсионные резервы, НПФ – пенсионные накопления, ПФР, ВИ[[1]](#footnote-1), ИП[[2]](#footnote-2),СК, СРО, ГК/ГФ[[3]](#footnote-3): |  |
| Один объект контроля – 1 балл |
|  | Количество управляющих компаний, с которыми заключены договоры об оказании услуг специализированного депозитария | количество управляющих компаний, с которыми заключены договоры об оказании услуг специализированного депозитария: | 6 |
|  | Суммарный размер собственных средств специализированного депозитария и страхового покрытия по договорам страхования профессиональной деятельности специализированного депозитария | суммарный размер собственных средств организации, осуществляющей деятельность специализированного депозитария, и страхового покрытия по заключенным организацией договорам страхования профессиональной деятельности специализированного депозитария[[4]](#footnote-4) | 6 |
|  | Коэффициент покрытия КП(спецдеп) контролируемого спецдепозитарием имущества | покрытие собственным капиталом и страховым покрытием суммарного объема контролируемого спецдепозитарием имущества4,[[5]](#footnote-5) | 3 |
|  | Коэффициент общей рентабельности деятельности специализированного депозитария | отношение прибыли до налогообложения к выручке от продажи услуг специализированным депозитарием | 3 |
|  | Персонал специализированного депозитария | количество сотрудников подразделения управления рисками/сотрудников, осуществляющих функции по организации системы управления рисками | 2[[6]](#footnote-6) | 5[[7]](#footnote-7) |
| количество сотрудников подразделения внутреннего контроля/сотрудников, осуществляющих внутренний контроль  | 2 |
| доля штатных сотрудников подразделения, осуществляющего деятельность специализированного депозитария, имеющих квалификационный аттестат серии 6.0 | 1 |
|  | Совмещение деятельности специализированного депозитария с иными видами деятельности | организация не совмещает деятельность специализированного депозитария с иными видами деятельности на рынке ценных бумаг (кроме депозитарной и регистраторской деятельности) | 3 |
| организация совмещает деятельность специализированного депозитария с иными видами деятельности на рынке ценных бумаг (кроме депозитарной и регистраторской деятельности) или только с банковской деятельностью | 2 |
| организация совмещает деятельность специализированного депозитария с иными видами деятельности на рынке ценных бумаг (помимо депозитарной и регистраторской деятельности) и с банковской деятельностью | 1 |
|  | Страхование профессиональной деятельности | наличие документального подтверждения соответствия договора страхования профессиональной деятельности специализированного  депозитария требованиям ПАРТАД или иной, признаваемой СРО НФА организации | 2 |
|  | Внедрение системы мер управления рисками деятельности специализированного депозитария[[8]](#footnote-8) | наличие документального подтверждения (действующего в рейтинговый период) соответствия профессиональной деятельности специализированного депозитария стандарту СРО, членом которого является специализированный депозитарий  | 3 |
| наличие документального подтверждения (действующего в рейтинговый период) соответствия системы внутреннего контроля специализированного депозитария стандарту ПАРТАД или СРО, членом которой является специализированный депозитарий, или признанным международным стандартам[[9]](#footnote-9)  | 3 |
| наличие документального подтверждения (действующего в рейтинговый период) соответствия системы управления рисками специализированного депозитария стандарту ПАРТАД или СРО, членом которой является специализированный депозитарий, или признанным международным стандартам[[10]](#footnote-10) | 3 |
|  | Обеспечение защиты информации6 | наличие документального подтверждения (действующего в рейтинговый период) соответствия специализированного депозитария требованиям к обеспечению защиты информации при осуществлении деятельности в сфере финансовых рынков в целях противодействия осуществлению незаконных финансовых операций, признаваемого ПАРТАД/ СРО НФА | 2 |
|  | Соответствие системы менеджмента качества требованиям международных стандартов6 | сертификата (действующего в рейтинговый период) соответствия системы менеджмента качества специализированного депозитария требованиям международного стандарта ISO 9001:2015[[11]](#footnote-11) | 2 |

**При расчете данных позиций рейтинга используются следующие методы:**

**Метод 1. (Пункты 1-3, 5-7): ранжирование по максимальному значению.**

Расчет производится следующим образом: определяется максимальное значение показателя по всем участникам рейтинга. После этого значения баллов для каждого специализированного депозитария по данному показателя определяется по формуле X = CURVALUE\*WEIGHT/MAXVALUE, где CURVALUE - значение поля для данной компании, WEIGHT - вес критерия согласно методике расчета рейтинга, MAXVALUE - максимальное значение данного поля.

При двойном ранжировании показателя производится повторное ранжирование по максимальной величине суммы значений, полученных при первичном ранжировании по каждому подпоказателю.

**Метод 2. (Пункты 4, 8-12): ранжирование по критерию.**

Каждой организации при соответствии её деятельности установленному показателю (критерию) присваивается установленное количество баллов. Для получения итогового рейтингового балла величины рейтинга специализированного депозитария все значения баллов по всем показателям методики (с учетом двойного ранжирования) суммируются.

1. накопления для жилищного обеспечения военнослужащих (военная ипотека) [↑](#footnote-ref-1)
2. ипотечное покрытие (ИП), выпущенное в соответствии с законодательством Российской Федерации об ипотечных ценных бумагах [↑](#footnote-ref-2)
3. государственные корпорации/государственные фонды [↑](#footnote-ref-3)
4. Специализированным депозитариям, совмещающим свою деятельность с банковской по умолчанию присваивается максимальный балл в отношении размера их покрытия контролируемого имущества, который не учитывается для расчета количества баллов по пунктам 6 и 7 Методики у небанковских специализированных депозитариев. [↑](#footnote-ref-4)
5. КП(cдеп) = (СК + СП) / РС(cдеп) - коэффициент покрытия контролируемого спецдепозитарием имущества, где: СК - собственный капитал (собственные средства) организации; СП - страховое покрытие по заключенным организацией договорам страхования спецдепозитарной деятельности; РС(деп) – суммарный объем контролируемого спецдепозитарием имущества [↑](#footnote-ref-5)
6. в случае возложения функций по организации системы управления рисками на контролера данный сотрудник указывается только по строке «количество сотрудников подразделения внутреннего контроля/сотрудников, осуществляющих внутренний контроль» [↑](#footnote-ref-6)
7. для расчета данного показателя используется двойное ранжирование: сначала по каждой строке, а затем по сумме баллов [↑](#footnote-ref-7)
8. показатели, предусмотренные пунктами 12, 13 и 14 Методики учитываются в расчете Национального рейтинга специализированных депозитариев по мере предоставления в ПАРТАД/СРО НФА надлежаще оформленных подтверждений соответствия cоответствующим стандартам и требованиям, предоставленных организациями, признанными ПАРТАД / СРО НФА [↑](#footnote-ref-8)
9. COSO Internal Control – Integrated Framework (2013) [↑](#footnote-ref-9)
10. COSO Enterprise Risk Management – Integrated Framework (2017), COSO Enterprise Risk Management (2004) [↑](#footnote-ref-10)
11. выданного организацией, аккредитованной ПАРТАД/СРО НФА [↑](#footnote-ref-11)