



2015 лет вместе

Роль специализированного депозитария в системе обеспечения сохранности активов НПФ и страховых компаний

Павел Прасс
Генеральный директор

22 декабря 2015

Институт специализированных депозитариев

Требование обязательного наличия специализированных депозитариев у различных категорий участников рынка закреплено **нормативными актами**.



Функции специализированного депозитария

Депозитарный учет и хранение
(custody)

Ответственное хранение
имущества

Контроль и согласование
сделок по распоряжению
имуществом

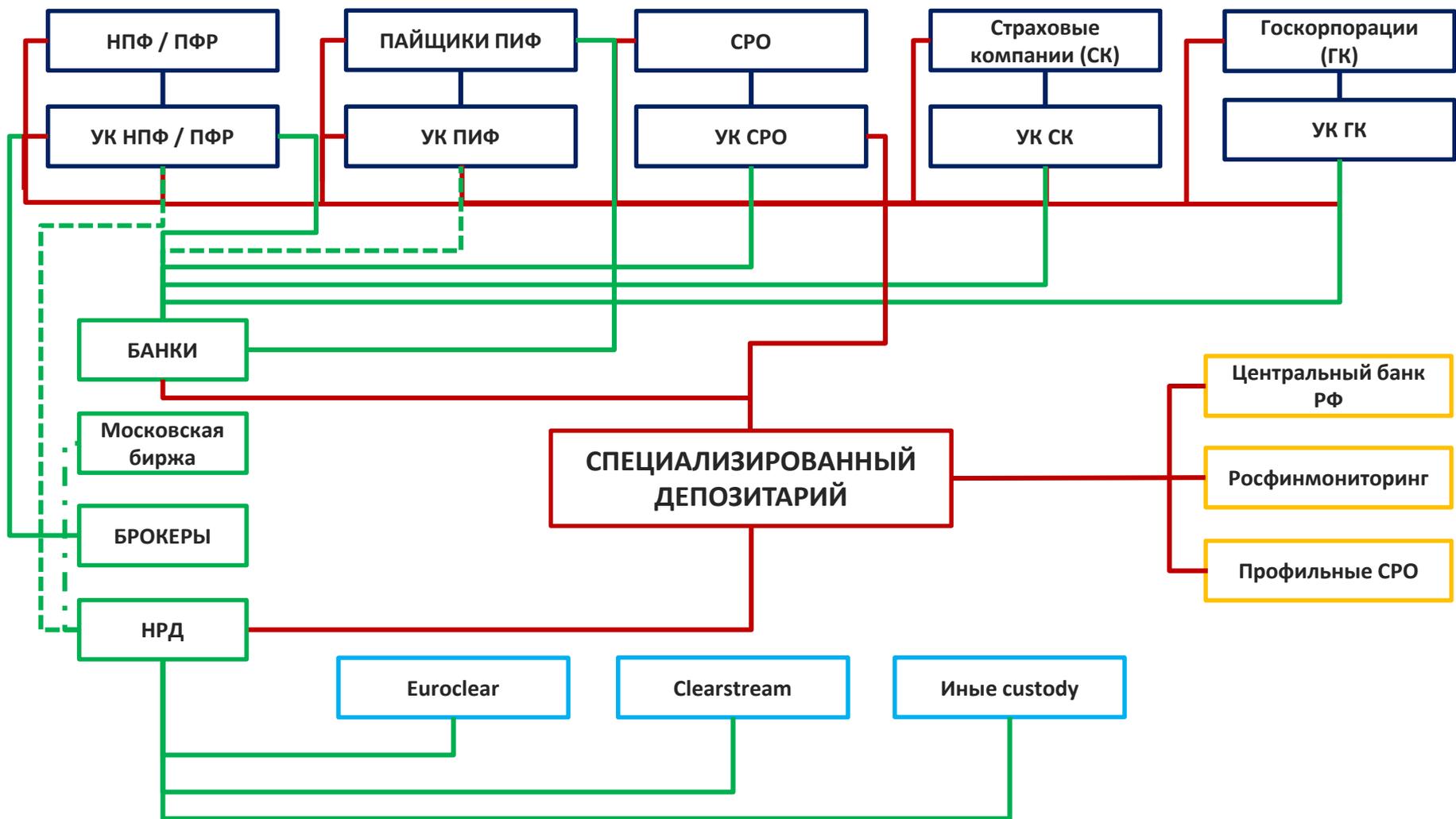
Учет операций с активами

Расчет стоимости чистых
активов (NAV)

Ведение реестра владельцев
паев инвестиционных фондов

Формирование обязательной и дополнительной отчетности

Взаимодействие с участниками рынка



Функции специализированного депозитария для НПФ

Хранение ценных бумаг и учет имущества,

в которые размещены пенсионные резервы и инвестированы пенсионные накопления.

Контроль:

- соблюдения нормативных требований при размещении пенсионных резервов и инвестировании пенсионных накоплений;
- соблюдения управляющей компанией инвестиционной декларации;
- устранения выявленных нарушений;
- ежедневный предконтроль: согласование сделок, проверка на соответствие состава активов;
- ежедневный постконтроль: проверка заключенных сделок на соответствие состава и структуры активов.

Уведомление управляющей компании, ПФР и Центрального банка о нарушениях:

- инвестиционной декларации;
- порядка размещения пенсионных резервов и инвестирования пенсионных накоплений;
- неустранении в срок выявленных ранее нарушений.

Ежедневный расчёт стоимости активов,

составляющих собственные средства, пенсионные резервы и пенсионные накопления.

Данные и отчетность:

- обязательная отчетность для Центрального банка о выполненных операциях и совершенных сделках по ценным бумагам, стоимости активов;
- сверка отчетности управляющей компании по инвестированию средств пенсионных накоплений;
- для бухгалтерского и налогового учета в соответствии с учетной политикой фонда, в том числе для отчетности по МСФО;
- для реализации систем риск-менеджмента фонда;
- ведение журнала выявленных нарушений.

Функции специализированного депозитария для СК

Хранение ценных бумаг и учет финансовых вложений,
в которые инвестированы активы страховых компаний.

Контроль
соответствия состава активов нормативным требованиям к размещению собственных средств и страховых резервов.

Ежедневный расчет стоимости активов,
составляющих собственные средства и страховые резервы.

Данные и отчетность:

- ежемесячная обязательная отчетность для Центрального банка и страховых компаний;
- отчеты для составления бухгалтерской отчетности, обязательной отчетности страховых компаний, в том числе формы № 7 «Отчет о составе и структуре активов»;
- подготовка аналитических отчетов с детальным анализом результатов управления активами.

Специализированный депозитарий – это...

	В день	В год
Входящие документы	6 000	700 000
Операции с ценными бумагами по отчетам брокеров	17 400	6 351 000
Депозитарные операции	226	45 740
Операции в реестрах паевых инвестиционных фондов	200	75 000
Согласия на сделки	40	13 758
Согласия на платежи	280	67 645
Отчеты клиентам и в Центральный банк	540	130 000

Процессы специализированного депозитария

Запрос клиента

Внутренние процессы ИНФИНИТУМ

Результат для клиента

Запрос на согласие

30
специализированных программных
продуктов

Согласие на сделку

Первичный документ

> 1 700 Гб
баз данных

> 500
справочников

- **Отчетность обязательная**
- **Отчетность дополнительная**
- **Фиксация нарушений или их отсутствия**

> 65 000
инвестиционных активов

747
контрольных процедур

> 200
нормативно-правовых актов

> 1 300
регламенты, инструкции, шаблоны, ответы
регулирующих органов, позиции

> 1 000
информационных источников на
мониторинге

160
систем Банк-Клиент

Платежка

Акцепт платежа

Вопрос

Ответ на вопрос

Осуществление контроля за инвестированием

	2010	2014
Ведение учета		
Количество проводок на основе документов	14 299 231	17 325 150
Количество стандартных операций	353 396	559 189
Контроль предварительный		
Количество зарегистрированных согласий	49 117	83 541
Контроль последующий		
Количество введенных за год контрольных показателей по ограничениям инвестиционных деклараций	5 269	7 965
Количество введенных за год контрольных показателей по нормативным ограничениям	96	138

Установлено отношений
с различными банками

160

Договоры на использование
систем Банк-Клиент

300

Используется
сертификатов ключей

347

Контрольные показатели

Показатель	Всего	Автоматизированы
Пенсионные накопления	131	115 (88%)
Пенсионные резервы	174	147 (84%)
Госкорпорации и учреждения	25	25 (100%)
Росвоенипотека	45	40 (89%)
Саморегулируемые организации	60	57 (95%)
Страховые компании	84	81 (96%)
Паевые инвестиционные фонды, ипотечное покрытие	228	166 (51%)

Предварительный контроль:

слабоавтоматизируемые и не подлежащие автоматизации показатели

Последующий контроль:

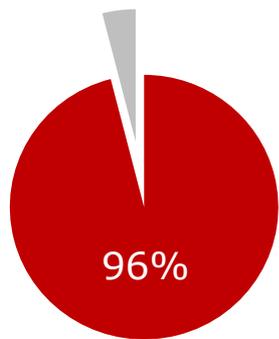
автоматизированные и подлежащие автоматизации показатели

Рынок специализированных депозитариев

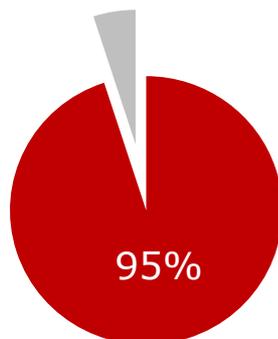
В настоящее время в России **выдано 39 лицензий** на осуществление спецдепозитарной деятельности, из них:

- 23 специализированных депозитария – несовместителя;
- 10 специализированных депозитариев – банков;
- 6 специализированных депозитариев – инвестиционных компаний.

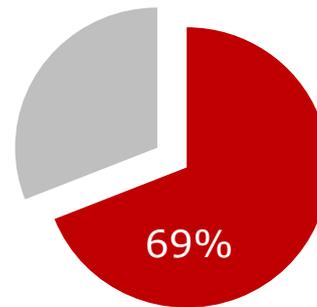
5 ведущих специализированных депозитариев консолидируют*



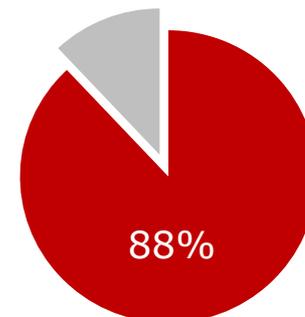
негосударственных пенсионных фондов на обслуживании



совокупных активов (пенсионные накопления и пенсионные резервы)



страховых компаний на обслуживании



активов страховых компаний, подлежащих контролю

* Экспертная оценка по состоянию на 30.09.2015

Ключевые показатели деятельности ГК ИНФИНИТУМ*

15 лет на рынке

Количество сотрудников

321
человек

Имеют аттестаты

175
человек

Контролируемые активы

2 319,6
млрд руб.

Активы на хранении

1 295,2
млрд руб.

Количество инвестпортфелей

612

Количество клиентов

440

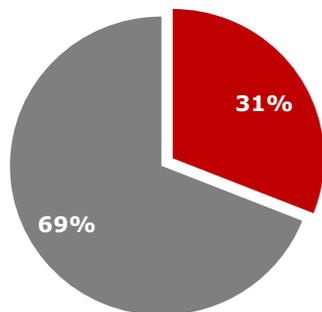
Под группой компаний «ИНФИНИТУМ» подразумеваются юридические лица, действующие в одной или нескольких смежных областях для целей реализации совместных проектов и идей: ООО «ИНФИНИТУМ Консалтинг», ООО «Технический центр «ИНФИНИТУМ», АО «Специализированный депозитарий «ИНФИНИТУМ», ООО «ЦДФ».

* По состоянию на 30.09.2015

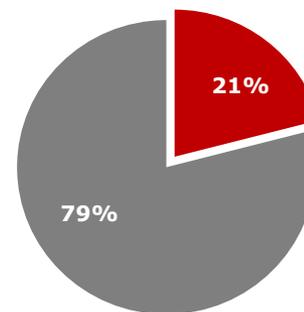


Клиенты ИНФИНИТУМ*

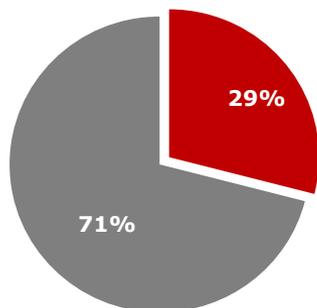
Доля по количеству НПФ



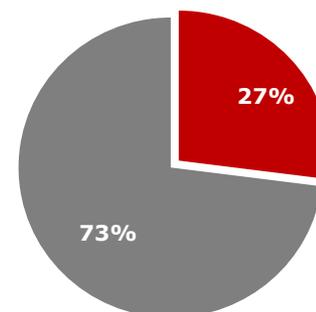
Доля по количеству ПФФ



Доля рынка по совокупным активам НПФ



Доля рынка по количеству СК



Крупнейшие клиенты

- НПФ: ГАЗФОНД, Алмазная осень, Социум, Наследие, Промагрофонд, КИТ Финанс
- Страховые компании: СОГАЗ, Ингосстрах, Альянс
- ФГКУ Росвоенипотека
- Госкорпорации и учреждения: Агентство по страхованию вкладов, Фонд содействия реформированию ЖКХ
- Управляющие компании: Российский фонд прямых инвестиций (РФПИ), Лидер, Открытие, Альфа-капитал, ФИНАМ, Газпромбанк – Управление активами, Райффайзен капитал

* Экспертная оценка по состоянию на 30.09.2015

■ ИНФИНИТУМ

■ Прочие



Рэнкинги и рейтинги

1

место

**Национальный рейтинг
спецдепозитариев***

1

место

**ТОП 10 спецдепозитариев
по количеству клиентов
на обслуживании***

2

место

**ТОП 10 спецдепозитариев по
стоимости контролируемого
имущества***

3

место

**ТОП 10 спецдепозитариев
по суммарной величине
собственных средств
и страхового покрытия***

A++

Рейтинговое агентство «Эксперт РА»

Наивысший рейтинг надежности (долгосрочной кредитоспособности) со стабильным прогнозом

A++

Рейтинговое агентство «АК&М»

Высший кредитный рейтинг заемщика (очень высокий уровень) по национальной шкале со стабильным прогнозом

AAA

ИНФИ/ПАРТАД

Высший рейтинг надежности в соответствии с Национальным рейтингом надежности депозитариев по итогам 1 полугодия 2015

* Рейтинги / Рэнкинги ИНФИ/ПАРТАД по итогам 1 полугодия 2015 года

Соответствие международным стандартам



Система менеджмента информационной безопасности
ISO/IEC 27001:2013 , подтверждается с 2012 года

Система управления сервисами
ISO/IEC 20000-1:2011 , подтверждается с 2013 года



Система менеджмента качества
ISO/IEC 9001:2008, подтверждается с 2012 года

Система риск-менеджмента
внедрена в 2015 году

FATCA
зарегистрирован в IRS с 2014 года

Система внутреннего контроля в целях ПОД/ФТ
в соответствии с требованиями Центробанка

СПАСИБО ЗА ВНИМАНИЕ!

АО «Специализированный депозитарий «ИНФИНИТУМ»

Москва, ул. Шаболовка, д. 31, корп. Б.

+7(495) 644-37-70, 663-35-78

www.specdep.ru

