

Утвержден  
годовым Общим собранием акционеров РДК (ЗАО)  
(протокол № А-1/2016 от «18» мая 2016 года)

Предварительно утвержден  
Советом директоров РДК (ЗАО)  
(протокол № СД-4/2016 от «15» апреля 2016 года)

**ГОДОВОЙ ОТЧЕТ  
ЗАКРЫТОГО АКЦИОНЕРНОГО  
ОБЩЕСТВА «РАСЧЕТНО-  
ДЕПОЗИТАРНАЯ КОМПАНИЯ»  
ЗА 2015 ГОД**

Генеральный директор РДК (ЗАО)

Главный бухгалтер РДК (ЗАО)



Л.В. Азимова

Е.В. Федорова

## **ОГЛАВЛЕНИЕ**

1. Положение РДК (ЗАО) на товарном и финансовом рынках в 2015 году
2. Основные результаты деятельности РДК (ЗАО) в 2015 году
3. Корпоративное управление и развитие
4. Перспективы развития РДК (ЗАО)
5. Основные сведения о Закрытом акционерном обществе «Расчетно-депозитарная компания»

*Приложение №1. Бухгалтерская (финансовая) отчетность РДК (ЗАО) за 2015 год, подготовленная в соответствии с РСБУ, и аудиторское заключение*

*Приложение №2. Финансовая отчетность за год, закончившийся 31 декабря 2015 года, подготовленная в соответствии с МСФО, и заключение независимых аудиторов*

# **1. Положение РДК (ЗАО) на товарном и финансовом рынках в 2015 году**

## **РДК (ЗАО) на товарном рынке**

В 2015 году РДК (ЗАО) сохранила свое уникальное положение в качестве ведущей клиринговой организации на российском биржевом товарном рынке. Несмотря на то, что основная доля включаемых в клиринг обязательств, как и в предыдущие годы, приходилась на обязательства из биржевых договоров в Секции «Нефтепродукты» Закрытого акционерного общества «Санкт-Петербургская Международная Товарно-сырьевая Биржа» (ЗАО «СПбМТСБ»), в 2015 году был отмечен заметный рост клиентской базы и принимаемых в клиринг обязательств из договоров поставки природного газа, заключаемых в Секции «Газ природный» ЗАО «СПбМТСБ».

В течение всего года совершенствовалась нормативная, технологическая и программно-техническая база клиринговой системы РДК (ЗАО). Клиринговой организацией был внедрен ряд разработок, значительно расширяющих рыночные возможности участников торгов и получивших высокую оценку со стороны клиентов.

Так, в октябре 2015 года РДК (ЗАО) совместно с ЗАО «СПбМТСБ» и группой «Газпром» был реализован проект по организации клиринга обязательств из договоров, заключаемых в Секции «Газ природный» ЗАО «СПбМТСБ» с поставкой на сутки.

В 2015 году продолжилась работа по развитию клирингового обслуживания на срочном товарном рынке ЗАО «СПбМТСБ». В начале года была внедрена схема различных уровней маржирования, что позволило обеспечить участникам клиринга возможность хеджировать большие объёмы позиций, не создавая повышенной нагрузки на коллективный гарантийный фонд.

Также в течение всего года велась подготовительная работа по проекту создания нового механизма ценообразования для российской экспортной нефти совместно с ЗАО «СПбМТСБ», Минэнерго России, ФАС России, Банком России и крупнейшими российскими нефтяными компаниями. Новый механизм ценообразования создается в форме поставочного биржевого фьючерсного контракта.

## **РДК (ЗАО) на финансовом рынке**

В 2015 году на российский фондовый рынок существенное влияние оказывали геополитические риски, падение цен на сырье, волатильность валютного рынка. В этой связи активность участников биржевых торгов, и соответственно количество проводимых

депозитариями операций снизились. Тем не менее, депозитарий РДК (ЗАО) показал достаточно стабильный результат в течение всего прошедшего года.

В 2015 году РДК (ЗАО) продолжила оказывать услуги кастодиального депозитария на рынке депозитарных услуг для всех категорий клиентов (в том числе профессиональных участников рынка ценных бумаг, банков, юридических и физических лиц).

РДК (ЗАО) удалось сохранить свои позиции и войти в Топ-30 крупнейших депозитариев по рыночной стоимости принятых на обслуживание ценных бумаг депонентов (по состоянию на 30 июня 2015 года), согласно проведенным Фондом развития финансовых исследований «Инфраструктурный институт» (ИНФИ) в сотрудничестве с ПАРТАД национальным рейтинговым исследованиям российских депозитариев и специализированных депозитариев.

По итогам рейтинговых исследований ИНФИ и ПАРТАД на основе комплексной (качественной, количественной и экспертной) оценки надёжности депозитариев, по итогам I полугодия 2015 года РДК (ЗАО) присвоен максимальный рейтинг надёжности - «ААА».

## 2. Основные результаты деятельности РДК (ЗАО) в 2015 году

### 2.1. Общие финансовые показатели

Итоги 2015 года показали сбалансированную устойчивость финансового положения РДК (ЗАО) и последовательное развитие основного профильного направления деятельности компании.

Активы РДК (ЗАО), согласно финансовой отчетности, показали существенный рост, в том числе ввиду расширения услуг по клиринговому обслуживанию на новых товарных рынках, по сравнению с предшествующим периодом рост составил 38,2%.

Чистые активы РДК (ЗАО) увеличились на 45,3%. Значительно увеличилась чистая прибыль компании, рост составил 96,7%. Увеличение прибыли РДК (ЗАО) обусловлено как положительными итогами профессиональной деятельности в отчетном периоде, так и эффективным финансовым планированием и управлением.

#### Показатели прибыли и капитала РДК (ЗАО)

млн. руб.

Показатели	2011	2012	2013	2014	2015	Изменение % (2015/2014)*
Чистая прибыль, млн. руб.	157,5	165,9	244,5	466,0	916,5	+96,7
Акционерный капитал, млн. руб.	1500,6	1500,6	1500,6	1500,6	1500,6	-
Нераспределенная прибыль, млн. руб.	242,4	390,1	191,3	170,1	921,4	+541,7
Чистые активы, млн. руб.	1768,8	1934,4	1753,9	1754,9	2549,5	+45,3
Прибыль на акцию, руб.	148,88	110,62	162,92	310,55	610,76	+96,7

\* значение показателя «Изменение % (2015/2014)» рассчитано исходя из базы расчета, сформированной в тыс. руб.

Следствием роста прибыли, несмотря на абсолютное увеличение активов, является положительный показатель рентабельности активов, составляющий 8,9% и характеризующий общее устойчивое положение компании.

Как следствие роста чистой прибыли РДК (ЗАО) в 2015 году, на 96,7% увеличился показатель прибыли на акцию.



Величина выручки от оказания услуг по клиринговому обслуживанию, составляющая 83,9% в общей структуре доходов РДК (ЗАО), сохранилась на уровне показателей предшествующего периода, что в целом соответствует общей динамике биржевой активности на организованных товарных рынках в 2015 году.

#### Структура доходов в разрезе основных направлений деятельности РДК (ЗАО)

млн. руб.

Показатели (без НДС),	2011	2012	2013	2014	2015	Изменение % (2015/2014)*
Выручка от оказания услуг, всего, в том числе:	214,7	202,5	287,3	357,7	349,3	-2,37
Клиринговая деятельность	155,5	138,6	221,4	297,4	293,1	-1,5
Деятельность по оказанию услуг ЭДО и обеспечения технического доступа к клиринговой системе	9,1	11,5	12,5	14,0	15,5	+11,1

Показатели (без НДС),	2011	2012	2013	2014	2015	Изменение % (2015/2014)*
Выручка от оказания услуг, всего, в том числе:	214,7	202,5	287,3	357,7	349,3	-2,37
Деятельность Удостоверяющего центра	0,3	3,1	4,4	5,3	7,7	+44,5
Депозитарная деятельность	49,8	49,3	49,0	41,0	33,0	-19,5

\* значение показателя «Изменение % (2015/2014)» рассчитано исходя из базы расчета, сформированной в тыс. руб.

В условиях сложного положения в экономике страны, кризисных явлений и серьезной стагнации рынка ценных бумаг отмечается заметное снижение объемов оказания кастодиальных услуг РДК (ЗАО) и соответствующее уменьшение величины выручки от депозитарной деятельности.



При этом РДК (ЗАО) удалось сохранить наполненный качественный рост финансовых показателей по видам деятельности, обеспечивающим клиринговое обслуживание участников торгов.

В частности, финансовые результаты деятельности Удостоверяющего центра показали существенный рост по сравнению с предшествующим периодом, дальнейшее развитие получает сфера оказания услуг электронного документооборота (увеличение составило 44,5% и 11,1% соответственно).

Устойчивое финансовое положение РДК (ЗАО) позволило в 2015 году принять решение годовому общему собранию акционеров о выплате дивидендов по итогам 2014 года. При этом выплата дивидендов не привела к снижению показателей прибыли по итогам 2015 года и продолжила позитивную дивидендную историю РДК (ЗАО).

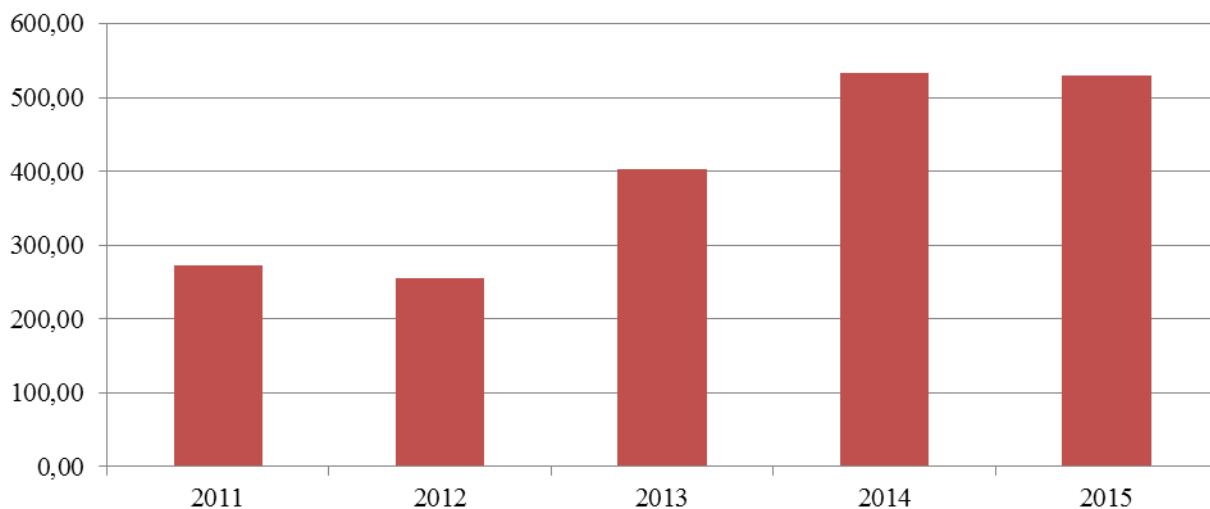
Таким образом, рост прибыли, рентабельности, увеличение активов, свидетельствующие об успешной профессиональной и финансовой деятельности в 2015 году, являются основой и потенциалом дальнейшего развития бизнеса РДК (ЗАО).

## **2.2. Клиринговая деятельность**

### **Клиринг на биржевом товарном спотовом рынке**

Объем обязательств, включенных в клиринговый пул РДК (ЗАО), на товарном спот рынке в 2015 году, в целом, сохранился на уровне 2014 года и составил 529,2 млрд. рублей.

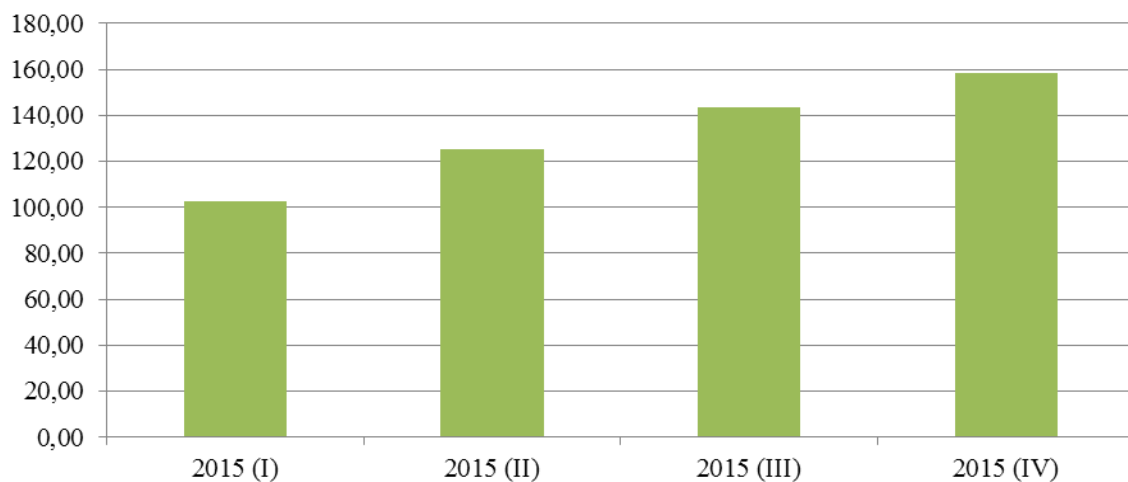
**Объем денежных обязательств, включенных в клиринг,  
млрд. руб.**



Поквартальные темпы прироста допущенных к клирингу денежных обязательств имели ярко выраженную положительную динамику к концу 2015 года. После заметного снижения объемов в первом полугодии 2015 года по отношению к этому же периоду 2014 года, во втором полугодии 2015 года объем допущенных к клирингу денежных обязательств достиг своего уровня 2014 года (3 квартал) и существенно превысил его в 4 квартале (на 11%).

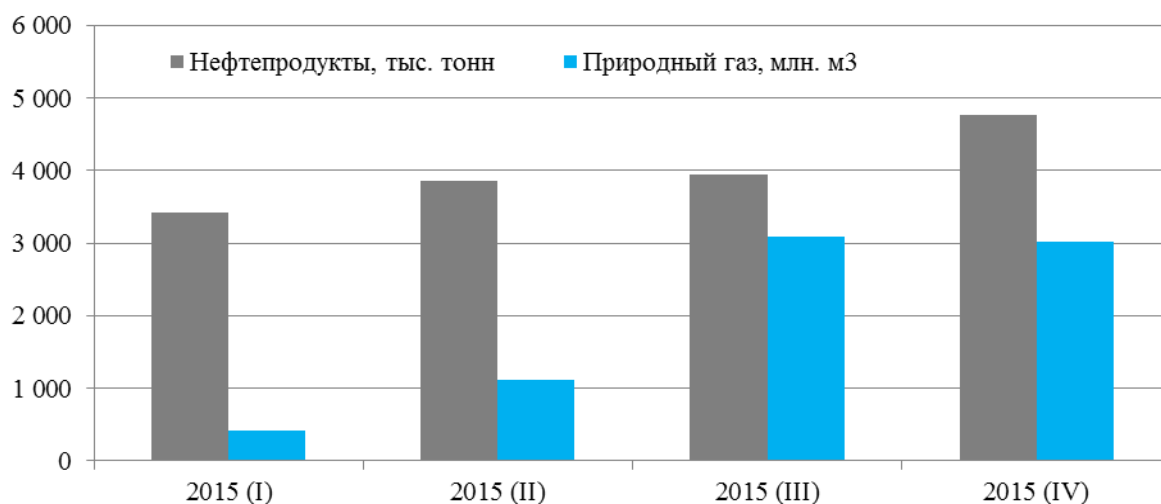


### Поквартальные объемы денежных обязательств, включенных в клиринг, в млрд. руб.



Объем допущенных к клирингу в 2015 году товарных обязательств из договоров поставки нефтепродуктов составил около 16 млн. тонн, что на 8% ниже объемов 2014 года (17,4 млн. тонн). При этом объем товарных обязательств, допущенных к клирингу в РДК (ЗАО) из договоров поставки природного газа, в течение 2015 года увеличился в несколько раз и составил по итогам всего года более 7,6 млрд. куб. метров.

### Объем товарных обязательств по нефтепродуктам и природному газу, включенных в клиринг



В 2015 году продолжился рост количества заявок на заключение договоров, обработанных в клиринговой системе РДК (ЗАО). Общее количество договоров, обязательства из которых были включены в клиринговый пул в течение 2015 года, составило 103,5 тыс., что на 19% больше, чем в 2014 году (87,2 тыс.).

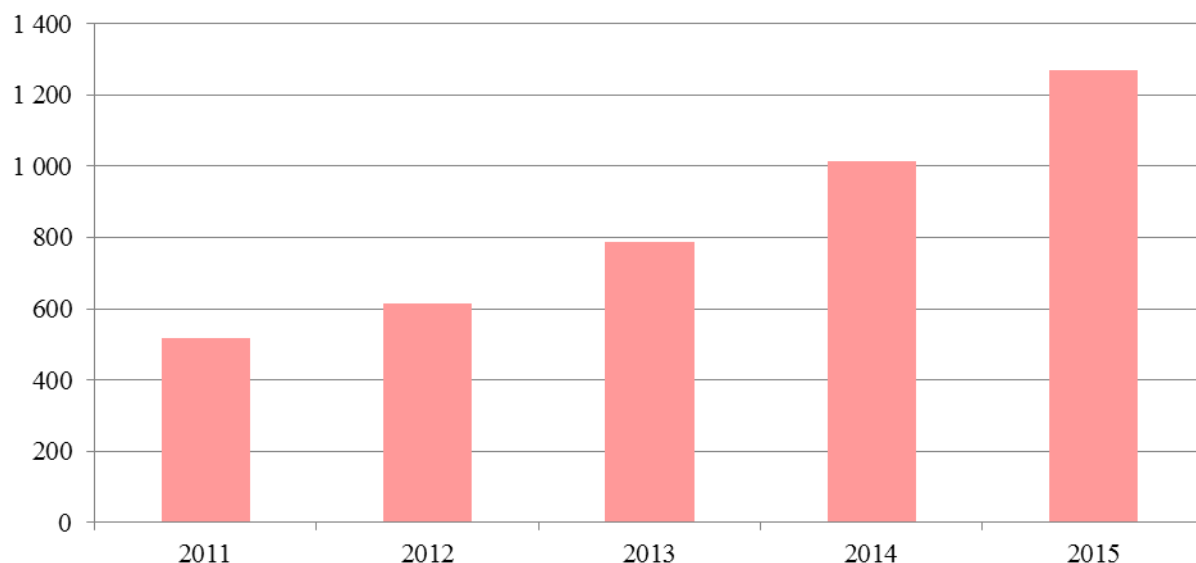
### Количество заявок и договоров, обработанных в системе клиринга



По итогам 2015 года количество участников клиринга в РДК (ЗАО) составило 1 269 компаний, то есть за год был отмечен двадцати пяти процентный рост клиентской базы. Как и в предыдущем году, этот рост был во многом обусловлен расширением услуг РДК (ЗАО) в отношении новых сегментов товарных рынков, и прежде всего - биржевого рынка природного газа.

Принимая во внимание динамичный рост клиентской базы РДК (ЗАО) на спот товарном рынке, в течение 2015 года особое внимание уделялось совершенствованию клиентского сервиса компании. Так, в первой половине 2015 года было внедрено персональное обслуживание для наиболее активных участников клиринга и закрепление за VIP клиентами персональных менеджеров с возможностью круглосуточного доступа по сотовой связи. С июля 2015 года в РДК (ЗАО) было организовано обслуживание первичных обращений клиентов через колл-центр ГПБ (АО), специализирующийся на решении задач дистанционного клиентского сервиса. Данные мероприятия самым позитивным образом отразились на качестве обслуживания клиентов и получили с их стороны положительную оценку.

## Динамика роста количества участников клиринга на спот рынке

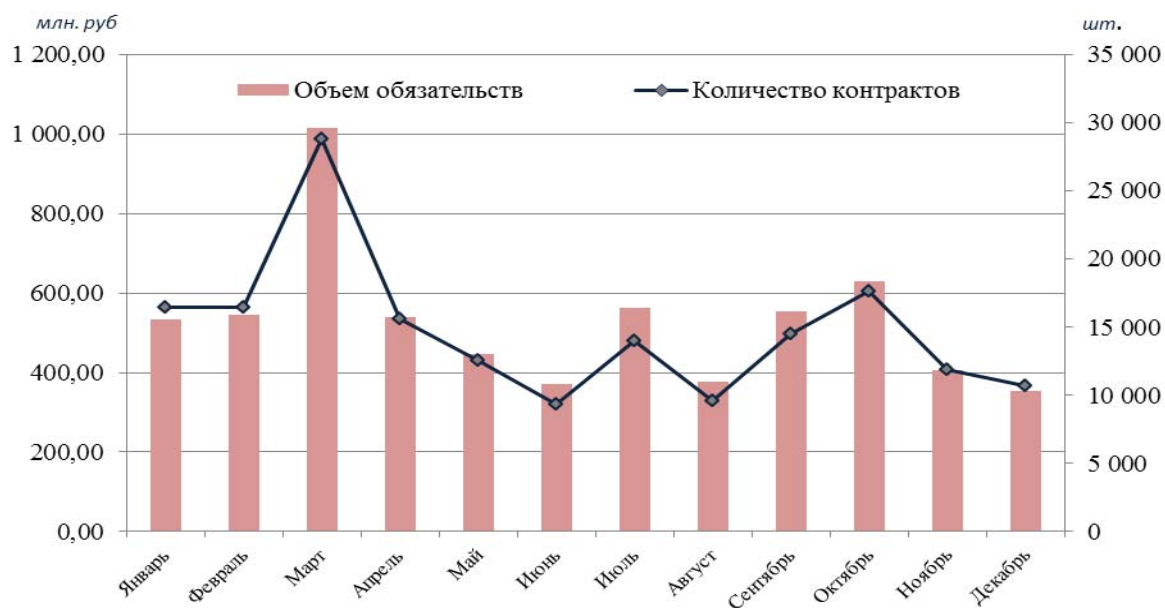


### Клиринг на биржевом товарном срочном рынке

РДК (ЗАО) выполняет функции центрального контрагента по срочным контрактам и оказывает клиринговые услуги в секции срочного рынка ЗАО «СПбМТСБ».

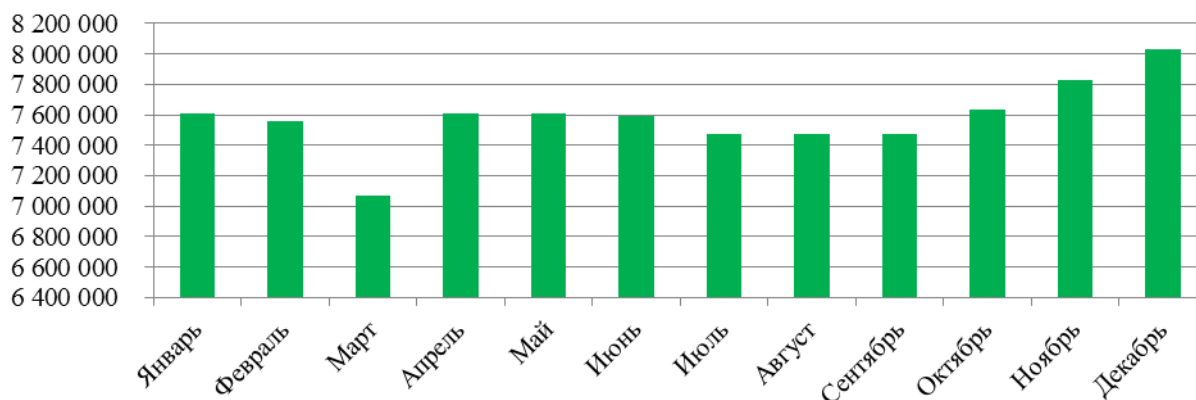
Совокупный объем обязательств, включенных в клиринговый пул РДК (ЗАО), в 2015 году составил более 6,3 млрд. рублей (177 499 контрактов). Среднедневной объем открытых позиций составил 63,5 млн. рублей (1 790 контрактов).

### Совокупный объем обязательств, включенных в клиринговый пул в 2015 году



Объем коллективного гарантийного фонда на конец 2015 года составил 8 млн. рублей.

### Объем коллективного гарантийного фонда в 2015 году, руб.



В качестве центрального контрагента по срочным контрактам РДК (ЗАО) в 2015 году исполнила 100% своих обязательств по срочным контрактам.

В 2015 году специалисты РДК (ЗАО) приняли участие в целом ряде профессиональных конференций, форумов и семинаров по тематике товарных рынков и рынков производных финансовых инструментов. В течение года специалисты клиринговой организации участвовали в ряде обучающих семинаров и лекций по срочному рынку, проведенных ЗАО «СПБМТСБ». Также проведены обучающие семинары по технологиям клиринга на срочном рынке, подготовленные сотрудниками РДК (ЗАО). В мероприятиях приняли участие как представители компаний нефтяного сектора российской экономики, производители и потребители нефтепродуктов, так и представители крупнейших инвестиционных и брокерских компаний.

В течение 2015 года РДК (ЗАО) уделяла большое внимание развитию клиринговых технологий на срочном товарном рынке с целью создания благоприятных условий, обеспечивающих интересы участников этого рынка и способствующих привлечению новых участников. Так, в первом квартале в клиринговой системе срочного рынка реализованы и внедрены различные уровни маржирования портфелей. Данная доработка обеспечивает участникам клиринга возможность хеджировать большие объёмы позиций, не создавая повышенной нагрузки на коллективный гарантийный фонд, за счёт увеличенных требований к размеру индивидуального клирингового обеспечения (депозитной маржи) участников клиринга.

В связи с изменениями в Федеральные законы «О клиринге и клиринговой деятельности», «О несостоятельности (банкротстве)» и Положением Банка России о деятельности по проведению организованных торгов, были реализованы соответствующие

изменения в клиринговой системе срочного рынка: доработана регистрация клиентов участников клиринга, предусмотрены дополнительные меры по спасению средств клиентов.

Также в течение всего года велась подготовительная работа по проекту создания нового механизма ценообразования для российской экспортной нефти совместно с ЗАО «СПбМТСБ», Минэнерго России, ФАС России, Банком России и крупнейшими российскими нефтяными компаниями. В рамках этого проекта создается новый поставочный биржевой контракт – фьючерс на нефть, торгуемый на российской биржевой площадке ЗАО «СПбМТСБ» в секции срочного рынка. Поставка физических объемов сырой нефти на экспорт в рамках исполнения фьючерсов будет осуществляться по незакрытым на дату исполнения позициям на условиях, разработанных совместно с ЗАО «СПбМТСБ» и ведущими российскими нефтяными компаниями на основе их действующих торговых практик. Биржевые контракты на известные на мировом рынке потоки нефти Юралс и ВСТО будут исполняться с базисами поставки в российских портах Приморск/Усть-Луга и порт Козьмино соответственно. Дополнительно будет запущен в обращение поставочный фьючерс на дизель с поставкой через порт Приморск, что поможет создать прозрачный механизм ценообразования на экспортные светлые нефтепродукты.

30 ноября 2015 года в рамках реализации данного проекта РДК (ЗАО) и ЗАО «СПбМТСБ» начали тестовые торги поставочными фьючерсными контрактами на экспортную нефть и экспортный дизель. Тестовые торги проводятся на игровом сервере, доступ к тестовым торгам предоставляется всем потенциальным пользователям данного биржевого инструмента (нефтяным компаниям – экспортерам, покупателям российской нефти и дизеля, брокерам и другим участникам торговли). В рамках торгов участники могут отладить технические аспекты подключения к биржевой площадке, ознакомиться с торговой системой биржи и протестировать различные стратегии, подавая заявки и совершая тестовые сделки.

### **2.3. Депозитарная деятельность**

В течение 2015 года РДК (ЗАО) продолжила дальнейшее развитие и совершенствование депозитарных технологий в соответствии с изменениями законодательства о рынке ценных бумаг, и о противодействии легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма.

Изменения в области законодательства о рынке ценных бумаг, вступившие в силу 1 июля 2015 года, а также новые нормативные акты Банка России потребовали внесения изменений во внутренние документы, связанные с осуществлением депозитарной деятельности, в том числе в Условия осуществления депозитарной деятельности РДК (ЗАО). Новая редакция Условий была введена в действие 5 ноября 2015 года.

В 2015 году были проведены соответствующие процедуры в целях реализации Политики соответствия требованиям FATCA РДК (ЗАО) для определения и присвоения FATCA-статуса счетам депо, открытым в РДК (ЗАО).

Выплата дивидендов за 2014 год депонентам РДК (ЗАО) была проведена в плановом порядке, депозитарий успешно адаптировался к роли налогового агента по ценным бумагам и своевременно провел выплату доходов своим депонентам.

**Основные показатели депозитарной деятельности РДК (ЗАО)  
по состоянию на 31 декабря 2015 года**

Рыночная стоимость хранимых активов, млрд. рублей	0,368
Количество открытых счетов (в том числе счетов депо), шт.	169
Количество ценных бумаг, находящихся на хранении и учете, млн. шт.	57,4
Количество акций ПАО «Газпром», находящихся на хранении и учете, млн. шт.	2,70
Количество эмитентов, ценные бумаги которых находятся на обслуживании в РДК (ЗАО), шт.	7
Количество обслуживаемых в РДК (ЗАО) выпусков ценных бумаг, шт.	7

**2.4. Информационно-технологическая деятельность и Удостоверяющий центр**

В 2015 году деятельность в области информационных технологий была в основном сконцентрирована на внутренних направлениях работ. Традиционно большое внимание было уделено планомерному развитию бизнес-систем, обеспечивающих автоматизацию основных видов деятельности РДК (ЗАО), вопросам внутренней автоматизации, развитию технологической инфраструктуры. Основная цель – дальнейшее увеличение надежности и безопасности используемых приложений.

В первой половине 2015 года были введены в эксплуатацию новые тестовые стенды для клиринговых систем спот- и срочного рынков. Повышенная производительность новых стендов дала возможность оптимизировать процесс тестирования новых версий.

Во второй половине 2015 года была произведена полная плановая замена серверного оборудования клиринговой системы на спот-рынке, что дало возможность иметь дополнительный запас по производительности и другим ресурсам на боевом кластере клиринговой системы.

Также был осуществлен перевод малонагруженных сервисов на виртуальную инфраструктуру, что позволило сократить количество физических серверов, повысить надежность и удобство управления сервисами.

В течение второй половины года велась разработка и тестирование собственного программного обеспечения в целях реализации сервиса «Личный кабинет» для клиентов РДК (ЗАО). Внедрение данного сервиса позволит направлять документы и иную информацию в структурированном виде для повышения степени автоматизации обработки входящих документов. Ввод в промышленную эксплуатацию сервиса запланирован на первую половину 2016 года.

В течение всего года шла планомерная работа над автоматизацией составления отчетности для Банка России, которую РДК (ЗАО) с 2015 года обязана предоставлять и как профессиональный участник рынка ценных бумаг (депозитарий), и как клиринговая организация.

В 2015 году начаты работы по переводу резервных каналов связи на нового провайдера. В декабре 2015 года два из трех запланированных каналов были успешно введены в эксплуатацию, что позволило повысить оперативность переключения каналов в случае какой-либо аварии на основном канале (или проблем на коммутационном оборудовании провайдера) и надежность обеспечения связи офиса РДК (ЗАО) и дата-центра Макомнет.

В течение 2015 года продолжила успешную работу индивидуальная почтовая система (ИПС), что позволило клиентам РДК (ЗАО) получать регулярные отчеты с гарантированной доставкой и высоким уровнем безопасности.

Проведенные работы по регулярной поддержке и модернизации ИТ-инфраструктуры обеспечили безотказное функционирование всех необходимых бизнес-процессов компании.

В рамках собственной разработки программного обеспечения стартовало несколько новых проектов, и продолжали развиваться уже разрабатываемые:

- Спроектирована и реализована криптографически защищенная система обмена данными с участниками клиринга (WebOffice РДК). Система успешно прошла нагрузочные и функциональные тесты. Внедрение запланировано на первую половину 2016 года.
- Осуществлена миграция на web-платформу большинства используемых утилит, что значительно оптимизировало процедуры внедрения и сопровождения программного обеспечения.
- Существенно доработана клиринговая система спот-рынка в части расширения поддерживаемых инструментов (например, расчеты по сделкам с поставкой

через сутки в Секции «Газ природный» ЗАО «СПБМТСБ») и системных возможностей на уровне пользователей (например, выставление требований на неустойку в случае нарушений при отгрузке биржевого товара).

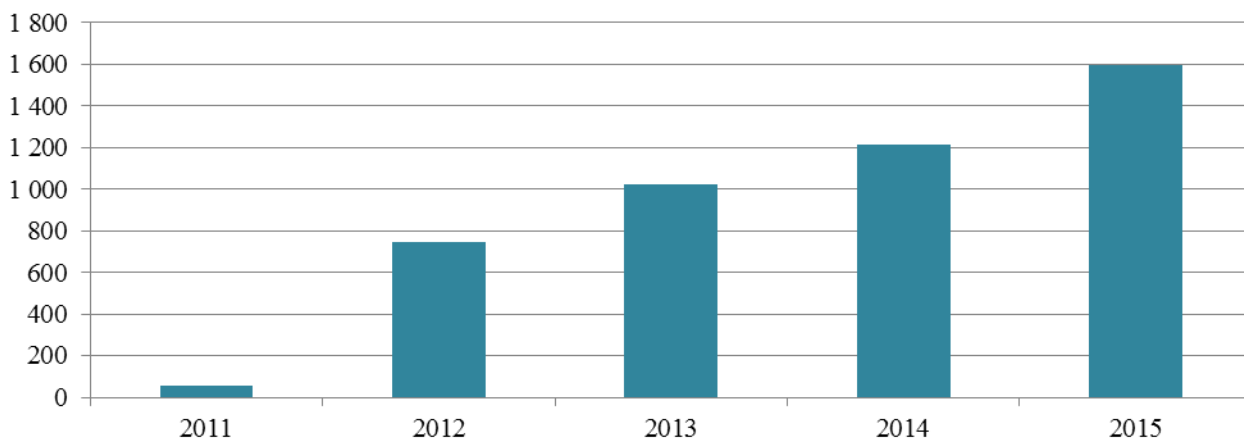
### **Удостоверяющий центр РДК (ЗАО)**

За отчетный период Удостоверяющий центр РДК (ЗАО) обеспечивал бесперебойное функционирование системы электронного документооборота (ЭДО), оперативное исполнение заявок клиентов на изготовление ключей проверки электронной подписи и реализацию лицензий на программное обеспечение Крипто-Про CSP, а также USB-ключей eToken Pro Java.

Слаженная работа специалистов РДК (ЗАО) позволила качественно и в срок предоставить клиентам весь спектр услуг Удостоверяющего центра, объемы которых возросли по всем позициям. В 2015 году сертификатов (клиентских и серверных) выпущено в 1,31 раза больше, чем в 2014 году, лицензий и ключей продано соответственно на 65,4 % и 81,7 % больше по сравнению с предыдущим отчетным периодом. Также отмечен годовой прирост в 1,65 раза объема сформированных и переданных в отправку по системе ЭДО клиентских пакетов документов.

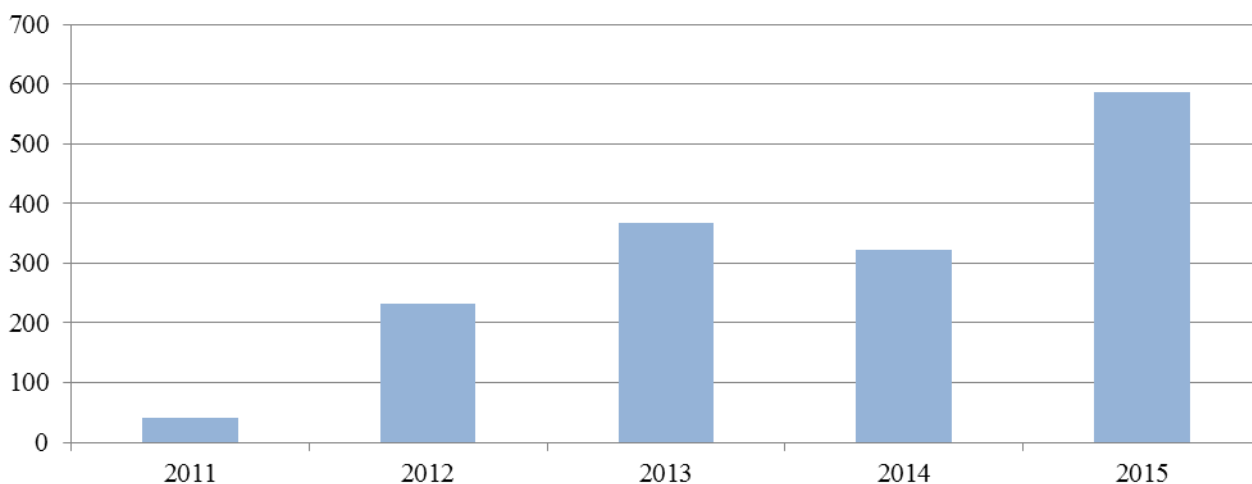
На прилагаемых графиках представлена динамика роста объемных показателей работы Удостоверяющего центра РДК (ЗАО).

#### **Количество оказанных услуг по изготовлению сертификатов**

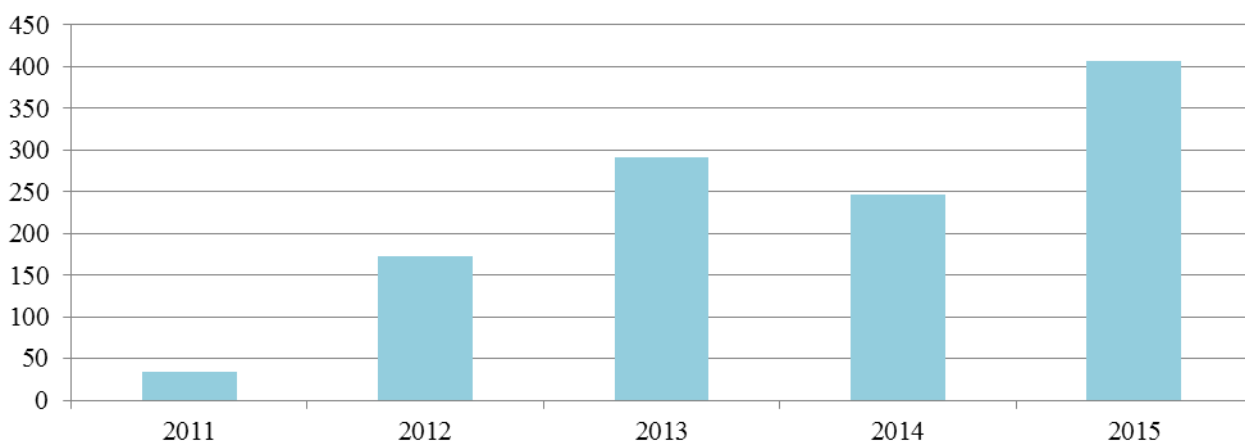




### Количество проданных USB-ключей eToken



### Количество проданных лицензий на СКЗИ Крипто-Про CSP



В 2015 году РДК (ЗАО) начата разработка механизмов автоматизированного обмена информацией между базами данных Удостоверяющего центра, CRM и 1С с использованием ИНН как уникального идентификатора. Данный механизм основан на созданном Web-интерфейсе и внедрении нового поля в сертификаты пользователей, что обеспечивает отправку и получение запросов на внесение ИНН и автоматизацию применения соответствующих изменений.

Кроме того, в отчетном периоде в рамках комплексного подхода к обслуживанию клиентов РДК (ЗАО) разработана система, позволяющая специалистам контактного (call) центра через Web-интерфейс получать данные о текущем статусе исполнения заявок Удостоверяющим центром.

Также в 2015 году проведена работа по подготовке и утверждению новой редакции Правил ЭДО РДК (ЗАО).

## 2.5. Управление рисками

В целях приведения системы управления рисками в соответствие новым требованиям регулятора<sup>1</sup>, а также с учетом ряда аспектов лучших международных практик и стандартов деятельности клиринговых организаций и центральных контрагентов<sup>2</sup>, в 2015 году был разработан, утвержден Советом Директоров и зарегистрирован Банком России комплект внутренних документов, определяющих Правила управления рисками РДК (ЗАО), в том числе:

- ✓ Политика управления рисками РДК (ЗАО) (далее – Политика);
- ✓ Порядок обеспечения непрерывности и восстановления деятельности РДК (ЗАО);
- ✓ Порядок стресс-тестирования системы управления рисками РДК (ЗАО) при осуществлении деятельности центрального контрагента;
- ✓ Методика оценки событий риска РДК (ЗАО);

а также Порядки управления отдельными видами рисков РДК (ЗАО).

Согласно Политике основными целями и задачами системы управления рисками РДК (ЗАО) являются: обеспечение достижения стратегических целей, сохранение активов и поддержание эффективности всех видов деятельности, предотвращение событий реализации рисков и минимизация их последствий, а также обеспечение непрерывности деятельности РДК (ЗАО).

Система управления рисками РДК (ЗАО) (далее также - Общество):

- является структурно интегрированной системой, элементы которой включены в бизнес-процессы Общества как их неотъемлемая часть, и предполагает участие в управлении рисками всех подразделений;

- предполагает непрерывный контроль управления рисками Общества и соответствия предпринимаемых мер воздействия на риски характеру и масштабу совершаемых операций.

- обеспечивает непрерывный мониторинг, оценку и анализ рисков, проведение на регулярной основе мероприятий, направленных на контроль функциональности действующих правил и процедур, обеспечение их соответствия текущим условиям,

---

<sup>1</sup> Положение Банка России от 12 марта 2015 года № 463-П.

<sup>2</sup> Principles for financial market infrastructures. April 2012 (Committee on Payment and Settlement Systems, Technical Committee of the International Organization of Securities Commissions – CPSS-IOSCO); Recommendations for Central Counterparties. March 2004 (CPSS-IOSCO); Public quantitative disclosure standards for central counterparties. Consultative report. October 2013 (CPSS-IOSCO); Guidelines and Recommendations regarding the implementation of the CPSS-IOSCO Principles for Financial Market Infrastructures in respect of Central Counterparties. 4.9.2014. (European Securities and Markets Authority – ESMA); Regulation (EU) No 648/2012 of the European Parliament and the Council of 4 July 2012 on OTC derivatives, central counterparties and trade repositories.

пересмотр и модификацию устаревших методик, регламентов, аналитического и технологического обеспечения;

- подразумевает включение в ее структуру всех бизнес-процессов, когда необходимые элементы системы присутствуют во всех сферах деятельности, а оценка рисков и создание необходимых процедур управления рисками осуществляется, в том числе и для всех новых процессов на стадии их проектирования;

- предусматривает обеспечение всеми подразделениями доступа Управления мониторинга и контроля рисков и Лица, ответственного за управление регуляторным риском, ко всей необходимой для управления рисками информации;

- предусматривает документальную фиксацию фактов возникновения рисков клиринговой организации и воздействия на них, а также хранение информации, используемой для управления рисками, включая условия договоров, обязательства из которых допущены к клирингу с участием центрального контрагента;

- включает организацию внутреннего обучения работников Общества, функции которых непосредственно связаны с осуществлением основных видов деятельности Общества, по вопросам выявления, идентификации и оценки рисков, а также контроля сопутствующих рисков;

- включает в себя регулярную отчетность по управлению рисками, представляемую органам управления Общества.

Система управления рисками Общества непрерывно совершенствуется при изменениях внешних факторов, а также при модернизации стратегии и принципов работы РДК (ЗАО).

Система управления рисками включает в себя управление следующими основными видами рисков, присущими деятельности РДК (ЗАО):

Вид риска	Определение вида риска	При осуществлении каких видов деятельности Общества подвергается указанному виду риска
<b>ФИНАНСОВЫЕ РИСКИ</b>		
<b>Кредитный риск</b>	риск возникновения убытков у Общества вследствие неисполнения, несвоевременного либо неполного исполнения должником финансовых обязательств перед Обществом в соответствии с условиями договоров.	во всех видах деятельности Общества: - при выполнении функций центрального контрагента на срочном рынке, вследствие возможного неисполнения участником клиринга (далее – УК) своих обязательств, - при оказании клиринговых, депозитарных услуг и услуг Удостоверяющего центра в случае неисполнения

		контрагентами своих обязательств по оплате услуг.
<b>Рыночный риск</b>	риск возникновения расходов (убытков) у Общества вследствие неблагоприятного изменения рыночной стоимости финансовых инструментов или иных активов, в которые инвестированы средства организации или средства, предоставленные ей в качестве обеспечения исполнения обязательств.	в ходе клиринговой и хозяйственной деятельности: - при проведении инвестиционных операций с собственными средствами (капиталом), - при использовании в собственных интересах средств, предоставленных ей УК в качестве обеспечения исполнения обязательств.
<b>Кастодиальный риск</b>	риск возникновения убытков у Общества вследствие утраты имущества Общества или имущества, переданного ей в качестве обеспечения исполнения обязательств, вследствие действий или бездействия лица, ответственного за хранение этого имущества и учет прав на это имущество.	в ходе клиринговой и депозитарной деятельности, а также при осуществлении хозяйственной деятельности.
<b>Риск ликвидности</b>	риск возникновения расходов (убытков) у Общества вследствие недостаточности имущества в распоряжении Общества для удовлетворения требований его кредиторов по передаче этого имущества в установленный срок.	в ходе клиринговой и хозяйственной деятельности: - вследствие реализации кастодиального риска (т.е. утраты имущества или обеспечения), - вследствие непредвиденных задержек при конвертации / продаже обеспечения, предоставленного УК в финансовых инструментах, отличных от денежных средств в рублях (при выполнении функции центрального контрагента), - при использовании в собственных интересах средств, предоставленных УК в качестве обеспечения.
<b>Системный риск</b>	риск возникновения убытков у Общества вследствие возникновения события, при котором неспособность выполнить свои обязательства одного или нескольких УК вызывает неспособность выполнить свои обязательства надлежащим образом других УК.	- при выполнении функций центрального контрагента на срочном рынке вследствие возможного неисполнения УК своих обязательств из срочных контрактов, - в ходе проведения процедуры принудительной ликвидации позиций УК («эффект домино») на срочном рынке.

## НЕФИНАНСОВЫЕ РИСКИ

<b>Операционной риск</b>	риск убытков у Общества вследствие недоработок и отказов в работе информационных систем, сбоях внутренних процессов, ошибочных действий или бездействия сотрудников, а также внешних событий, негативно влияющих на операционную деятельность Общества.	во всех видах деятельности Общества.
<b>Правовой риск</b>	риск убытков у Общества вследствие неоднозначности толкования норм права.	во всех видах деятельности Общества.
<b>Регуляторный риск</b>	риск убытков у Общества из-за несоблюдения законодательства, внутренних документов Общества, стандартов, правил и кодексов саморегулируемых организаций (если они являются обязательными для Общества), а также в результате применения санкций и (или) иных мер воздействия со стороны надзорных органов.	во всех видах деятельности Общества.
<b>Коммерческий риск</b>	риск превышения расходов Общества над доходами (не связанный с реализацией кредитного и кастодиального рисков) (неверные решения или ненадлежащее их исполнение, воздействие неблагоприятных факторов на процессы планирования и т.п.)	во всех видах деятельности Общества.
<b>Конфликт интересов</b>	риск убытков Общества из-за неправомерного использования информации, финансовых и иных ресурсов, полученных при осуществлении определенного вида деятельности Общества, для реализации функций и/или урегулирования потерь, возникших при осуществлении других видов деятельности.	во всех видах деятельности Общества.

В таблице приведены виды рисков в сопоставлении с видами деятельности РДК (ЗАО).

Вид риска	Направления деятельности				
	Клиринговая деятельность		Депозитарная деятельность	Деятельность Удостоверяющего центра	Хозяйственная деятельность
	на спот-рынке (рынке биржевого товара)	на срочном рынке (в том числе деятельность центрального контрагента)			
<b>ФИНАНСОВЫЕ РИСКИ</b>					
кредитный	да	да	да	да	да
рыночный	да	да	нет	нет	да
кастодиальный	да	да	да	нет	да
ликвидности	да	да	нет	нет	да
системный	нет	да	нет	нет	нет
<b>НЕФИНАНСОВЫЕ РИСКИ</b>					
операционный	да	да	да	да	да
правовой	да	да	да	да	да
регуляторный	да	да	да	да	да
коммерческий	да	да	да	да	да
конфликта интересов	да	да	да	да	да

Процесс управления рисками осуществляется на всех уровнях управления РДК (ЗАО) в соответствии с компетенцией органов управления.

Помимо специального структурного подразделения – Управления мониторинга и контроля рисков, в компетенцию которого входит непосредственный мониторинг и контроль всех перечисленных выше видов рисков, в соответствии с требованиями Банка России в РДК (ЗАО) назначено специальное лицо, ответственное за управление регуляторным риском в части соответствия деятельности РДК (ЗАО) требованиям Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте», принятых в соответствии с ним нормативных актов Банка России, документов клиринговой организации, связанных с клиринговой деятельностью и зарегистрированных в Банке России.

Кроме того, при Совете директоров РДК (ЗАО) функционирует Комитет по риск-менеджменту, к компетенции которого относится экспертиза системы управления рисками в части клиринговой деятельности РДК (ЗАО), предварительное одобрение документов, определяющих правила организации системы управления рисками. В состав данного

комитета входят ведущие специалисты РДК (ЗАО), ЗАО «СПбМТСБ», ПАО Московская Биржа, а также представители наиболее активных участников клиринга, таких как ПАО «Газпром нефть», АО «Открытие Брокер» и других.

На заседаниях указанного комитета в 2015 году был рассмотрен ряд вопросов по управлению рисками, в том числе:

- ✓ Предварительное одобрение модификации базовых принципов определения лимитов на объем предоставляемых банками гарантий.
- ✓ Об одобрении документов по управлению рисками РДК (ЗАО).

Помимо утверждения новых Правил управления рисками РДК (ЗАО) в отчетном периоде был реализован ряд проектов, направленных на развитие системы управления рисками, в том числе:

- В клиринговой системе на срочном рынке ЗАО «СПбМТСБ» реализована возможность создавать портфели со второго уровня маржирования. Второй уровень маржирования позволяет открывать значительные объемы позиций, при этом повышенный уровень риска компенсирован величиной ставок депозитной маржи для снижения нагрузки на гарантийные фонды;
- Модифицирована методология определения лимитов на объем банковских гарантий, допускаемых в обеспечение участников клиринга;
- Проведен анализ бизнес-процессов с высоким уровнем операционного риска, выработаны меры по оптимизации с целью его снижения;
- Проведено обучение руководителей подразделений РДК (ЗАО) по вопросам идентификации и сбора данных по событиям рисков;
- Организован централизованный сбор сведений о событиях рисков в специализированной базе данных.

В течение года в штатном режиме осуществлялось ежедневное определение риск-параметров на срочном рынке, контроль финансового состояния участников клиринга срочного рынка на основе квартальной отчетности, ежедневное определение ставок обеспеченности на рынках биржевого товара, контроль финансового состояния кредитных организаций, в том числе гарантирующих банков, лимитирование объемов принимаемых к учету банковских гарантий.

На ежемесячной основе проводилась подготовка отчетов о результатах стресс-тестирования системы управления рисками, на ежеквартальной основе проводилась подготовка отчетов о результатах сценарного моделирования дефолтов кредитных организаций, банковские гарантии которых принимаются в качестве обеспечения

обязательств участников клиринга на товарных рынках. Также на ежеквартальной основе предоставлялся отчет Банку России о мерах по управлению операционным риском.

## **2.6. Внутренний контроль и внутренний аудит**

В 2015 году в РДК (ЗАО) непрерывно осуществлялся внутренний контроль соответствия клиринговой и депозитарной деятельности РДК (ЗАО) законодательству Российской Федерации о клиринге и клиринговой деятельности, о рынке ценных бумаг, о защите прав и законных интересов инвесторов на рынке ценных бумаг, о рекламе, о противодействии отмыванию доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма, о противодействии неправомерному использованию инсайдерской информации.

В целях реализации РДК (ЗАО) требований Федерального закона «О клиринге и клиринговой деятельности» Службой внутреннего контроля клиринговой деятельности проводилась работа по осуществлению внутреннего контроля клиринговой деятельности и внедрению процедур комплаенса.

Функции по осуществлению внутреннего контроля профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг возложены на Заместителя Генерального директора – контролера РДК (ЗАО).

Летом 2015 года в Федеральный закон «О клиринге и клиринговой деятельности» были внесены изменения, в соответствии с которыми клиринговая организация обязана организовать и осуществлять внутренний аудит. Во исполнение указанных норм федерального закона, в РДК (ЗАО) было образовано самостоятельное структурное подразделение – Служба внутреннего аудита, основной функцией которой в 2015 году стало осуществление необходимой работы по организации внутреннего аудита, разработке документов, плана работы внутреннего аудита.

Деятельность по всем направлениям внутреннего контроля и внутреннего аудита нацелена на недопущение использования недобросовестных финансовых схем, на минимизацию рисков финансовых потерь и нанесения ущерба репутации РДК (ЗАО), а также на соблюдение интересов его акционеров, партнеров и клиентов.

### **Внутренний контроль клиринговой деятельности**

В 2015 году Службой внутреннего контроля (далее – СВК) на постоянной основе осуществлялся контроль соответствия клиринговой деятельности РДК (ЗАО) и ее сотрудников требованиям законодательства Российской Федерации, в том числе нормативных правовых актов Банка России, а также уставу и внутренним документам



клиринговой организации, включая проверку деятельности структурного подразделения, ответственного за управление рисками.

Деятельность по проведению комплексных проверок осуществлялась в соответствии с Планом проведения проверок СВК клиринговой деятельности на 2015 год, утвержденным Советом директоров РДК (ЗАО). Проверки СВК включали в себя такие процедуры, как запросы, изучение документов, анализ электронных массивов данных Системы клиринга на биржевых товарных рынках, в том числе с использованием методов случайного и систематического отбора данных, а также автоматизированных контрольных процедур. Кроме того, в рамках осуществления функций СВК по основным направлениям внутреннего контроля в 2015 году проводилась оценка эффективности системы внутреннего контроля, оценка эффективности применяемых методов (способов) сохранности имущества клиринговой организации, процессов и процедур внутреннего контроля, а также оценка качества подхода к управлению рисками в РДК (ЗАО). Внеплановые проверки по распоряжению органов управления РДК (ЗАО) в 2015 году не проводились.

Отчетность по итогам проведенных СВК комплексных проверок предоставлялась на рассмотрение Совету директоров и Генеральному директору в 2015 году в порядке и сроки, установленные нормативными правовыми актами Банка России.

Рекомендации СВК учтены при разработке внутренних нормативных документов, регулирующих клиринговую деятельность РДК (ЗАО) на рынке биржевого товара и срочном товарном рынке, а также в процессе оптимизации ряда бизнес-процессов.

В целях обеспечения эффективности осуществления внутреннего контроля в 2015 году проводилась работа по оптимизации применяемых алгоритмов проведения проверок, в том числе внедрение элементов автоматизации процедур контроля при осуществлении клиринга на биржевых товарных рынках.

С 1 июля 2015 года в связи с вступлением в силу значительных изменений в Федеральный закон «О клиринге и клиринговой деятельности» были изменены нормы по вопросам организации и осуществления внутреннего контроля клиринговой организации. Согласно новым положениям установлено требование в отношении подчиненности и подотчетности руководителя СВК (контролера) единоличному исполнительному органу клиринговой организации. На начало 2016 года запланированы мероприятия по внесению соответствующих изменений в Положение о внутреннем контроле клиринговой деятельности РДК (ЗАО) и регистрации данного внутреннего нормативного документа в Банке России.

В конце 2015 года по предложению руководителя СВК подготовлен План проведения проверок Службой внутреннего контроля клиринговой деятельности на 2016 год, который утвержден Советом директоров РДК (ЗАО) в начале 2016 года.

### **Внутренний контроль профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг**

Произошедшие в 2015 году изменения в законодательстве о рынке ценных бумаг, а также введение в действие новых нормативных актов Банка России в части регулирования и осуществления пруденциального надзора за профессиональными участниками рынка ценных бумаг, потребовали от РДК (ЗАО) внесения изменений во внутренние документы, в том числе связанные с осуществлением внутреннего контроля профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, а также принятия иных организационных мер.

Так, в I квартале 2015 года вступили в силу нормативные акты Банка России, согласно которым не допускается совмещение функций по осуществлению внутреннего контроля профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг и функций по реализации Правил внутреннего контроля в целях противодействия легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма (далее – ПОД/ФТ). В этой связи в мае 2015 года в РДК (ЗАО) были проведены организационные изменения, связанные с созданием отдельной Службы (Службы финансового мониторинга и отчетности), которой были переданы функции по осуществлению внутреннего контроля в целях ПОД/ФТ, ранее осуществляемые заместителем генерального директора - контролером. Также была разработана и введена в действие новая редакция Инструкции о внутреннем контроле РДК (ЗАО), которая учитывает указанные выше требования Банка России.

Внутренний контроль профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг осуществлялся путем проведения проверок депозитарных операций и документов депозитарного учета на предмет соблюдения законодательства и нормативных актов Банка России, внутренних нормативных документов РДК (ЗАО), связанных с осуществлением депозитарной деятельности, с учетом вступивших в силу нововведений. В том числе, осуществлялся контроль за своевременным внесением во внутренние нормативные документы РДК (ЗАО) необходимых изменений, соответствующих новым требованиям законодательства о рынке ценных бумаг, нормативным актам Банка России (в том числе касающихся лицензионных требований, уточнения порядка проведения залоговых операций, введения понятия «операционного дня», раскрытия информации о продолжительности операционного дня депозитария, уточнения порядка проведения сверки количества ценных бумаг с вышестоящими депозитариями и регистраторами и других).

Утверждение Банком России с 1 апреля 2015 года новых форм отчетности для профессиональных участников потребовало от РДК (ЗАО) разработки и внедрения новых механизмов и процедур контроля за своевременностью и достоверностью направляемой в Банк России отчетности.

По результатам осуществления внутреннего контроля депозитарной деятельности представлялись отчеты Генеральному директору и Совету директоров РДК (ЗАО).

В целях приведения деятельности РДК (ЗАО) в соответствие с нормативным документом Банка России о снижении рисков при осуществлении клиринговой деятельности, вступившим в силу в мае 2015 года, в ноябре 2015 года на заместителя генерального директора - контролера были возложены также функции лица, ответственного за управление регуляторными рисками клиринговой деятельности.

### **Внутренний контроль в целях противодействия легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма (ПОД/ФТ)**

В результате изменений, внесенных в Федеральный закон от 7 августа 2001 года № 115-ФЗ «О противодействии легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма» и принятые в связи с ним нормативные акты, в целях соблюдения требований законодательства в 2015 году были утверждены новые редакции Правил внутреннего контроля в целях противодействия легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма РДК (ЗАО), а также иные внутренние документы, устанавливающие отдельные процедуры в сфере ПОД/ФТ.

У клиринговых организаций, в том числе, выполняющих функции центрального контрагента, появилась обязанность предоставлять информацию об участниках клиринга, а также информацию о деятельности по оказанию клиринговых услуг уполномоченному органу по его запросу. В связи с этим, РДК (ЗАО) утвержден специальный Порядок действий работников в целях определения наличия достаточных оснований полагать, что деятельность участников клиринга на биржевом товарном рынке связана с легализацией (отмыванием) доходов, полученных преступным путем, и финансированием терроризма. В соответствии с данным Порядком проводился постоянный анализ деятельности участников клиринга. Основания полагать, что деятельность участников клиринга на биржевом товарном рынке связана с легализацией (отмыванием) доходов, полученных преступным путем, и финансированием терроризма, не выявлены.

В рамках осуществления внутреннего контроля в целях ПОД/ФТ проводилась работа по обновлению идентификационных данных о депонентах, их представителях, выгодоприобретателях, бенефициарных владельцах, включая пересмотр уровня риска

клиентов. В целях реализации программ ПОД/ФТ в РДК (ЗАО) осуществлялось изучение операций, осуществляемых РДК (ЗАО) и клиентами, с целью выявления операций, подлежащих обязательному контролю, и необычных операций. По результатам проводимого анализа подозрений о связи клиентов с отмыванием преступных доходов или с финансированием терроризма не возникало.

В целях соблюдения требований к подготовке и обучению кадров в области внутреннего контроля в целях ПОД/ФТ сотрудники РДК (ЗАО) прошли обучение, в том числе в форме участия в специализированных семинарах, получив необходимые знания и навыки в данной области.

В части организационной структуры, согласно требованиям Банка России, была создана Служба финансового мониторинга и отчетности РДК (ЗАО) под руководством ответственного сотрудника по ПОД/ФТ.

### **Внутренний контроль в целях противодействия неправомерному использованию инсайдерской информации и манипулированию рынком**

В целях реализации Федерального закона «О противодействии неправомерному использованию инсайдерской информации и манипулированию рынком и о внесении изменений в отдельные законодательные акты Российской Федерации» в 2015 году РДК (ЗАО) на регулярной основе проводились мероприятия, направленные на соблюдение норм данного закона.

В Обществе осуществлялась проверка соответствия оснований для включения лиц в список инсайдеров и исключения из него, а также соблюдения порядка и сроков уведомления лиц, включенных в список инсайдеров РДК (ЗАО) и исключенных из него.

Проводился анализ законодательных и иных нормативных актов, устанавливающих требования к осуществлению внутреннего контроля в целях противодействия неправомерному использованию инсайдерской информации и манипулированию рынком, в результате которого был сделан вывод, что основания для внесения изменений в Перечень информации, относящейся к инсайдерской РДК (ЗАО), отсутствовали.

Уведомления от лиц, включенных в список инсайдеров РДК (ЗАО), об осуществлении ими операций с финансовыми инструментами и (или) товарами, в отношении которых эти лица признаются инсайдерами, не поступали.

Уведомления о включении РДК (ЗАО) в список инсайдеров других организаций, а также об исключении РДК (ЗАО) из списка инсайдеров организаций, ранее включивших РДК (ЗАО) в свой список инсайдеров, не поступали.

Требования о передаче списка инсайдеров РДК (ЗАО) организаторам торговли, через которых совершаются операции с финансовыми инструментами, иностранной валютой и (или) товаром, и в Банк России, не поступали.

### **Внутренний аудит**

Во исполнение норм Федерального закона «О клиринге и клиринговой деятельности» в части организации и осуществления внутреннего аудита, в РДК (ЗАО) было образовано самостоятельное структурное подразделение – Служба внутреннего аудита, основной функцией которой в 2015 году стало осуществление необходимой работы по организации внутреннего аудита, разработке документов, плана работы внутреннего аудита.

В декабре 2015 года Советом директоров РДК (ЗАО) утверждено Положение о внутреннем аудите (зарегистрировано Банком России в феврале 2016 года).

При организации работы внутреннего аудита РДК (ЗАО) учитывались как лучшие российские практики, применяемые в настоящее время кредитными организациями, так и положения Международных профессиональных стандартов внутреннего аудита, требования нормативных актов ЕС, затрагивающие вопросы внутреннего аудита в центральных контрагентах, и другие.

### **3. Корпоративное управление**

Корпоративное управление РДК (ЗАО) направлено на поддержание высокого уровня, соответствующего требованиям российского законодательства и общепринятым корпоративным стандартам и практикам, а также на обеспечение эффективности операционной деятельности, системы управления рисками и взаимодействия с ключевыми акционерами.

Система корпоративного управления РДК (ЗАО), структура органов управления и их компетенция во многом обусловлены специальными требованиями, установленными законодательством о клиринговой деятельности и о рынке ценных бумаг. В соответствии с Федеральным законом «О клиринге и клиринговой деятельности» в конце 2015 года Советом директоров было утверждено Положение о принципах корпоративного управления Закрытого акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания».

Ключевые вопросы, касающиеся корпоративного управления РДК (ЗАО), рассматриваются Общим собранием акционеров. Общее руководство деятельностью РДК (ЗАО) осуществляется Советом директоров, руководство текущей деятельностью - единоличным исполнительным органом (Генеральным директором) и коллегиальным исполнительным органом (Правлением). Контроль за финансово-хозяйственной деятельностью осуществляется Ревизионной комиссией и внешними аудиторами РДК (ЗАО).

Ведение реестра акционеров РДК (ЗАО) осуществляет регистратор ЗАО «СР-ДРАГа».

Акционером, владеющим более 90 процентов акций РДК (ЗАО), является «Газпромбанк» (Акционерное общество). Изменения в структуре акционеров РДК (ЗАО) в течение 2015 года не происходили.

#### **3.1. Общее собрание акционеров РДК (ЗАО)**

Общее собрание акционеров является высшим органом управления РДК (ЗАО), участвуя в котором акционеры реализуют свое право по управлению РДК (ЗАО).

В 2015 году было проведено одно годовое Общее собрание акционеров РДК (ЗАО).

На годовом Общем собрании акционеров были приняты решения по обязательным вопросам, относящимся к компетенции Общего собрания акционеров, в том числе:

- Утверждение годового отчета Закрытого акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания» за 2014 год.
- Утверждение годовой бухгалтерской отчетности Закрытого акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания» за 2014 год, в том числе отчета о финансовых результатах Закрытого акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания».
- Распределение прибыли, в том числе определение размера и порядка выплаты дивидендов по итогам финансового года.

- Установление даты, на которую определяются лица, имеющие право на получение дивидендов.
- Избрание членом Совета директоров РДК (ЗАО).
- Избрание членом Ревизионной комиссии РДК (ЗАО).
- Утверждение аудитора РДК (ЗАО) для проведения аудита бухгалтерской отчетности, составленной в соответствии с Российскими стандартами бухгалтерского учета (РСБУ) за 2015 год, а также аудитора для проведения аудита финансовой отчетности, составленной в соответствии с Международными стандартами финансовой отчетности (МСФО) за 2015 год.

Были одобрены сделки, в совершении которых имеется заинтересованность и которые могут быть совершены в будущем в процессе осуществления РДК (ЗАО) обычной хозяйственной деятельности:

#### **1. Между РДК (ЗАО) и Банком ГПБ (АО):**

- Получение прав требования по банковским гарантиям, гарантом по которым выступает Банк ГПБ (АО), принципалом – участник клиринга, бенефициаром – РДК (ЗАО), на предельную сумму по каждой банковской гарантии – 1 000 000 000 рублей, или эквивалента в иностранной валюте по курсу Банка России на дату заключения соответствующей сделки, без ограничения количества сделок.
- Договоры банковского счета (в том числе, клирингового счета), соглашения о внесении изменений и дополнений в указанные договоры, дополнительные соглашения к ним, а также сделки, совершаемые на их основании, с предельной суммой по каждому договору (сделке), не превышающей 10 000 000 000 рублей, или эквивалента в иностранной валюте по курсу Банка России на дату заключения соответствующей сделки, без ограничения количества сделок.
- Договоры купли-продажи иностранной валюты, соглашения о внесении изменений и дополнений в указанные договоры, дополнительные соглашения к ним, а также сделки, совершаемые на их основании, с предельной суммой по каждому договору (сделке), не превышающей 10 000 000 000 рублей или эквивалента в иностранной валюте по курсу Банка России на дату заключения соответствующей сделки, без ограничения количества сделок.
- Рамочные (генеральные) договоры (соглашения) об общих условиях заключения депозитных операций, договоры депозитного вклада в рублях или иностранной валюте (в том числе с конвертацией суммы вклада), соглашения о внесении изменений и дополнений в указанные договоры, дополнительные соглашения к ним, а также сделки, совершаемые на их основании, с предельной суммой по каждому договору (сделке), не превышающей 10 000 000 000 рублей или эквивалента в иностранной валюте по курсу Банка России на дату заключения соответствующей сделки, без ограничения количества сделок.

- Договоры (соглашения) о порядке поддержания минимального неснижаемого остатка на счетах РДК (ЗАО), соглашения о внесении изменений и дополнений в указанные договоры, дополнительные соглашения к ним, а также сделки, совершаемые на их основании, с предельной суммой по каждому договору (сделке), не превышающей 10 000 000 000 рублей или эквивалента в иностранной валюте по курсу Банка России на дату заключения соответствующей сделки, без ограничения количества сделок.
- Кредитные договоры в рублях или иностранной валюте, соглашения о внесении изменений и дополнений в указанные договоры, дополнительные соглашения к ним, а также сделки, совершаемые на их основании, с предельной суммой по каждому договору (сделке), не превышающей 10 000 000 000 рублей или эквивалента в иностранной валюте по курсу Банка России на дату заключения соответствующей сделки, без ограничения количества сделок.
- Договоры по операциям с производными финансовыми инструментами на любые активы, соглашения о внесении изменений и дополнений в указанные договоры, дополнительные соглашения к ним, а также сделки, совершаемые на их основании, с предельной суммой по каждому договору (сделке) не превышающей 10 000 000 000 рублей или эквивалента в иностранной валюте по курсу Банка России на дату заключения соответствующей сделки, без ограничения количества сделок.
- Договоры счета депо владельца и/или доверительного управляющего (депозитарные договоры), договоры о междепозитарных отношениях, соглашения о внесении изменений и дополнений в указанные договоры, дополнительные соглашения к ним, а также сделки, совершаемые на их основании, с предельной суммой по каждому договору (сделке), не превышающей 1 000 000 000 рублей или эквивалента в иностранной валюте по курсу Банка России на дату заключения соответствующей сделки, без ограничения количества сделок.
- Договоры (соглашения) об обмене документами в электронном виде с помощью системы электронного документооборота (об организации системы электронного документооборота), соглашения о внесении изменений и дополнений в указанные договоры, дополнительные соглашения к ним, а также сделки, совершаемые на их основании, с предельной суммой по каждому договору (сделке), не превышающей 1 000 000 000 рублей или эквивалента в иностранной валюте по курсу Банка России на дату заключения соответствующей сделки, без ограничения количества сделок.
- Договоры (соглашения) об использовании Системы ГПБ-Дилинг, договор (регламент) удостоверяющего центра Банка ГПБ (АО), соглашения о внесении изменений и дополнений в указанные договоры, дополнительные соглашения к ним, а также сделки, совершаемые на их основании, без ограничения количества сделок.
- Агентские договоры по консультированию с использованием удаленных каналов



связи (каналов телефонной связи) физических и юридических лиц по вопросам, связанным с клиринговым обслуживанием РДК (ЗАО), соглашения о внесении изменений и дополнений в указанные договоры, дополнительные соглашения к ним, а также сделки, совершаемые на их основании, с предельной суммой по каждому договору (сделке), не превышающей 1 000 000 000 рублей или эквивалента в иностранной валюте по курсу Банка России на дату заключения соответствующей сделки, без ограничения количества сделок.

## **2. Между РДК (ЗАО) и ЗАО «СР-ДРАГА»**

- Договоры на ведение реестра владельцев ценных бумаг, соглашения о внесении изменений и дополнений в указанные договоры, дополнительные соглашения к ним, а также сделки, совершаемые на их основании, с предельной суммой по каждому договору (сделке), не превышающей 1 000 000 рублей или эквивалента в иностранной валюте по курсу Банка России на дату заключения соответствующей сделки, без ограничения количества сделок.

Крупные сделки в 2015 году РДК (ЗАО) не совершались.

## **3.2. Совет директоров**

Совет директоров осуществляет общее руководство деятельностью РДК (ЗАО).

При Совете директоров РДК (ЗАО) осуществляет свою деятельность Комитет по риск-менеджменту. Целью данного комитета является осуществление экспертизы системы управления рисками РДК (ЗАО), в том числе предварительное одобрение ряда документов, регламентирующих управление рисками клиринговой организации.

В 2015 году состав Совета директоров был переизбран в том же составе, что и в 2014 году.

### **Председатель Совета директоров РДК (ЗАО)**

Серегин Валерий Александрович      Первый Вице-Президент, член Правления Банка ГПБ (АО)

### **Члены Совета директоров РДК (ЗАО)**

Азимова Лариса Владимировна      Генеральный директор РДК (ЗАО)

Борисов Дмитрий Борисович      Управляющий директор Департамента корпоративного финансирования Банка ГПБ (АО)

Коломиец Александр Михайлович      Вице-Президент - начальник Департамента корпоративных долгосрочных вложений и акционерного капитала Банка ГПБ (АО)

Мелентьев Владимир Николаевич      управляющий директор Банка ГПБ (АО), с 01 марта 2016 года – управляющий директор РДК (ЗАО)

Члены Совета директоров доли в уставном капитале РДК (ЗАО) не имеют.

Права, обязанности и ответственность членов Совета директоров определяются Уставом и Положением о Совете директоров РДК (ЗАО). Порядок проведения заседаний Совета директоров РДК (ЗАО) определен указанным Положением.

В течение 2015 года было проведено 15 заседаний Совета директоров, в ходе которых принимались решения по текущим вопросам и приоритетным направлениям развития деятельности РДК (ЗАО).

В рамках стратегического планирования деятельности РДК (ЗАО) Советом директоров были утверждены следующие документы:

- Приоритетные направления развития РДК (ЗАО) в 2015 году (в части клиринговой и информационно-технологической деятельности);
- Приоритетные направления инвестирования денежных средств РДК (ЗАО) в 2015 году;
- Новая редакция Бюджет доходов и расходов РДК (ЗАО) на 2015 год;
- Бюджет доходов и расходов РДК (ЗАО) на 2016 год.

В 2015 году в соответствии с требованиями законодательства Российской Федерации, в целях дальнейшего развития и совершенствования приоритетного направления – клиринговой деятельности, РДК (ЗАО) были утверждены новые редакции Правил осуществления клиринговой деятельности Закрытого акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания» по договорам с биржевым товаром и Правил осуществления клиринговой деятельности Закрытого акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания» на срочном рынке ЗАО «СПбМТСБ». Также была утверждена новая редакция Положения о порядке аккредитации в РДК (ЗАО) кредитных организаций, банковские гарантии которых принимаются в качестве обеспечения обязательств участников клиринга на товарных рынках.

Была утверждена новая редакция Тарифов за услуги по осуществлению функций Удостоверяющего центра.

С учетом внесения изменений и дополнений в Федеральный закон «О рынке ценных бумаг» Советом директоров была утверждена новая редакция Условий осуществления депозитарной деятельности Закрытого акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания».

Советом директоров на постоянной основе рассматривались отчеты контролера по депозитарной деятельности, службы внутреннего контроля клиринговой деятельности.

В 2015 году Советом директоров был утвержден такой же, как в 2014 году, количественный и персональный состав комитета при Совете директоров РДК (ЗАО) по

риск-менеджменту (количество – 8 человек). При этом был определен срок, на который избираются члены указанного комитета при Совете директоров РДК (ЗАО), - до избрания следующего состава Комитета. Одновременно с определением персонального состава комитета на заседаниях Советов директоров были избраны председатель и заместитель председателя Комитета по риск-менеджменту.

Одновременно с этим в 2015 году был упразднен Комитет по технической политике при Совете директоров Закрытого акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания».

В соответствии с внесением изменений в законодательство Российской Федерации были утверждены:

- новая редакции Инструкции о внутреннем контроле Закрытого акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания».

- Положение о внутреннем аудите Закрытого акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания».

В 2015 году Совет директоров принял решение о признании утратившими силу Правил охраны конфиденциальности инсайдерской информации Закрытого акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания» и контроля за соблюдением требований Федерального закона «О противодействии неправомерному использованию инсайдерской информации и манипулированию рынком и о внесении изменений в отдельные законодательные акты Российской Федерации» и других нормативных правовых актов», утвержденных Советом директоров РДК (ЗАО) (протокол № СД-1/2011 от 24 февраля 2011 года). Новые документы утверждены Правлением РДК (ЗАО) в соответствии с его компетенцией.

В течение 2015 года решением Совета директоров была определена цена (денежная оценка) имущества по ряду сделок, а также принято решение об одобрении ряда сделок, в совершении которых имеется заинтересованность.

### **3.3. Исполнительные органы**

Руководство текущей деятельностью РДК (ЗАО) осуществляется единоличным исполнительным органом (Генеральным директором) и коллегиальным исполнительным органом (Правлением), которые подотчетны Совету директоров и Общему собранию акционеров РДК (ЗАО).

С февраля 2008 года Генеральным директором РДК (ЗАО) является Азимова Лариса Владимировна.

В состав Правления входят следующие работники РДК (ЗАО):

Азимова Лариса Владимировна, Генеральный директор, Председатель Правления;

Алешина Виктория Викторовна – Исполнительный директор;

Бажанова Лилия Юрьевна – Финансовый директор (до 14 августа 2015 года);

Гариков Денис Игоревич – Заместитель Генерального директора;

Спицын Леонид Евгеньевич – Технический директор;

Федорова Елена Валентиновна – Главный бухгалтер;

Шабунина Елена Алексеевна – Директор по правовым и корпоративным вопросам.

Размер вознаграждения Генерального директора и членов Правления РДК (ЗАО) определяется трудовым договором, заключаемым на основании решения Совета директоров РДК (ЗАО), а также решениями Совета директоров РДК (ЗАО).

В течение 2015 года было проведено 25 очных заседаний Правления, на которых, в том числе, были предварительно одобрены документы для их дальнейшего рассмотрения и утверждения на заседаниях Совета директоров.

В начале года Правлением был утвержден План работы РДК (ЗАО) на 2015 год, а также Отчет о выполнении плана работы за 2014 год. Кроме того, Правлением были рассмотрены и утверждены:

- Новая редакция Правил электронного документооборота Закрытого акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания».

- Концепция защиты информации в Информационной системе РДК (ЗАО).

- Концепция управления информационными потоками РДК (ЗАО).

- План приведения системы управления рисками РДК (ЗАО) в соответствие с требованиями Банка России, установленными Положением № 463-П от 12 марта 2015 года.

- Правила охраны конфиденциальности инсайдерской информации Закрытого акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания» и контроля за соблюдением требований Федерального закона «О противодействии неправомерному использованию инсайдерской информации и манипулированию рынком и о внесении изменений в отдельные законодательные акты Российской Федерации» и других нормативных правовых актов.

- Новая редакция Инвестиционной декларации по размещению средств Коллективного гарантийного фонда Закрытого акционерного общества «Расчетно-депозитарная компания» на срочном рынке ЗАО «СПбМТСБ».

В течение отчетного периода на рассмотрение Правления на постоянной основе выносились вопросы об утверждении изменений и дополнений в Список инсайдеров РДК (ЗАО).

### **3.4. Ревизионная комиссия**

Для осуществления контроля за финансово-хозяйственной деятельностью РДК (ЗАО) избирается Ревизионная комиссия.

В 2015 году решением годового Общего собрания акционеров 18 мая 2015 года был

избран следующий состав Ревизионной комиссии:

1. Голощапов Александр Петрович – главный специалист Управления акционерного капитала Банка и корпоративной отчетности Департамента корпоративных долгосрочных вложений и акционерного капитала Банка ГПБ (АО).

2. Гончарова Юлия Александровна – главный специалист Отдела обработки корпоративных событий эмитентов Управления по взаимодействию с внешними учетными системами и отчетности Депозитарного центра Банка ГПБ (АО).

3. Горьковой Константин Владимирович – директор проекта Дирекции сопровождения и модернизации депозитарных систем Депозитарного центра Банка ГПБ (АО).

До момента избрания указанной Ревизионной комиссии в состав Ревизионной комиссии по решению внеочередного Общего собрания акционеров от 30 сентября 2014 года входили:

1. Алексеева Лидия Васильевна - заместитель начальника Управления корпоративных отношений Департамента корпоративных долгосрочных вложений и акционерного капитала Банка ГПБ (АО).

2. Голощапов Александр Петрович - главный специалист Управления акционерного капитала Банка и корпоративной отчетности Департамента корпоративных долгосрочных вложений и акционерного капитала Банка ГПБ (АО).

3. Прусакова Марина Алексеевна - главный специалист Управления аудита дочерних структур Департамента внутреннего контроля Банка ГПБ (АО).

В соответствии с утвержденным планом в течение 2015 года регулярно проводились заседания Ревизионной комиссии.

Ревизионная комиссия проверяла финансово-хозяйственную деятельность РДК (ЗАО) согласно утвержденному плану проведения проверок в течение года и по итогам 2015 года в целом.

На заседаниях Ревизионной комиссии проводилась проверка:

- бухгалтерской отчетности РДК (ЗАО) за полугодие, 9 месяцев, год, в том числе бухгалтерского баланса и отчета о финансовых результатах РДК (ЗАО), а также сопроводительных документов, прилагаемых к годовой отчетности;
- расчета оценки стоимости чистых активов РДК (ЗАО).

### **3.5. Внешний аудит**

В соответствии с требованиями Федерального закона «О клиринге и клиринговой деятельности» клиринговая организация обязана составлять годовую консолидированную финансовую отчетность согласно МСФО, а также годовую бухгалтерскую (финансовую) отчетность. Данные виды финансовой отчетности подлежат обязательному аудиту.

Ежегодно для проведения проверки и подтверждения достоверности годовой

финансовой отчетности РДК (ЗАО) привлекает внешних аудиторов – профессиональные аудиторские организации.

Аудит бухгалтерской (финансовой) отчетности РДК (ЗАО), подготовленной в соответствии с РСБУ, осуществляет ООО Аудиторская фирма «АЕМ-АУДИТ».

Аудит финансовой отчетности, подготовленной в соответствии с МСФО, осуществляет ООО «ФБК ФИНАНС».

Проведение аудита финансовой отчетности и включение ее в состав годового отчета позволяет акционерам и клиентам объективно оценить достоверность бухгалтерского учета и отчетности РДК (ЗАО).

## 4. Перспективы развития РДК (ЗАО)

### 4.1. Клиринговая деятельность

Развитие клиринговых услуг на товарных спот рынках для РДК (ЗАО) в 2016 году останется приоритетной задачей.

Ряд проектов, уже начатых в 2015 году, планируется к внедрению в начале 2016 года. Среди этих проектов:

- **Промышленный запуск Системы электронного документооборота Web-офис для приема и регистрации входящих документов от участников клиринга**

Web-офис, как информационная платформа РДК (ЗАО), позволяет полностью автоматизировать процессы формирования, хранения, отправки/приема и регистрации электронных документов/поручений участников клиринга. Данная система успешно прошла свою апробацию в 2015 году. Одновременно с внедрением системы Web-офис планируется ввести обязательность присоединения к Правилам электронного документооборота РДК (ЗАО) для всех участников клиринга на спот товарных рынках. Прием к исполнению любых документов/поручений от участников клиринга в электронной форме останется бесплатным. При этом за прием и обработку документов от участников клиринга в бумажной форме будет взиматься отдельная плата согласно тарифам Клиринговой организации.

- **Совершенствование функционала удаленного рабочего места (УРМ) Системы клиринга**

Высокие требования, предъявляемые к клиринговой организации со стороны наиболее активных участников клиринга в части повышения оперативности и автоматизации документооборота, повышения уровня их информационного сопровождения, предполагают постоянную работу по функциональному развитию прикладных систем и программно-технических средств системы клиринга. Одним из важнейших направлений здесь является сопровождение удаленного рабочего места участников клиринга, причем как в части раскрытия информации для клиентов в режиме он-лайн, так и при совершении клиентами активных операций (транзакционные движения средств по учетным регистрам, управление приоритетностью проведения контроля обеспечения денежных обязательств в клиринговом пуле, проведение зачета встречных обязательств на двусторонней основе и другие).

В 2016 году РДК (ЗАО) намерена сосредоточить усилия по разработке **новой модели клирингового обслуживания на биржевом рынке природного газа – с участием центрального контрагента.**

С 1 декабря 2015 года вступил в силу Федеральный закон «О внесении изменения в часть вторую Налогового кодекса Российской Федерации», которым, в частности, установлено, что клиринговые организации имеют право включать в затраты, принимаемые к вычету при исчислении налога на прибыль, суммы налога, уплаченные поставщикам по приобретаемым товарам в целях осуществления функций центрального контрагента, а также для исполнения и (или) обеспечения исполнения допущенных к клирингу обязательств. Введение данной законодательной нормы позволяет приступить к практической реализации модели централизованного клиринга на товарных рынках.

С учетом накопленного опыта клиринга обязательств на товарном рынке природного газа, РДК (ЗАО) положительно оценивает перспективы данного проекта и его востребованность со стороны основных участников этого рынка. Новая модель клиринга и расчетов должна, с одной стороны, исключить риски для добросовестных продавцов по неисполнению перед ними обязательств по оплате газа (в том числе, его транспортировки), а также по его физическому отбору. С другой стороны, центральный контрагент с привлечением гарантирующих поставщиков закрывает риски для добросовестных покупателей в части срыва в поставках газа. При этом такая модель клиринга позволит на новом качественном уровне усовершенствовать саму схему биржевого рынка природного газа и использовать ее элементы при балансировке газа внутри газотранспортной системы ПАО «Газпром».

В 2016 году РДК (ЗАО) предполагает также внедрить **технологии клиринга на условиях поставки против платежа для рынка нефтепродуктов с привлечением внешнего оператора товарных поставок**. Предусмотренный законодательством институт оператора товарных поставок еще не нашел своего широкого применения. Вместе с тем, его появление на рынке нефтепродуктов обусловлено перспективами развития биржевой торговли на базисах крупнейших нефтебаз с возможностью проведения территориальных своп сделок. Оперативность поставок и сокращение сроков отвлечения денежных средств с момента совершения договора до его полного исполнения позволят привлечь на биржевой рынок новых потенциальных клиентов.

Среди основных приоритетных задач РДК (ЗАО) в 2016 году в части осуществления **клиринговой деятельности на товарном срочном рынке** необходимо выделить следующие проекты:

- **Проект поставочных фьючерсов на экспортную нефть и экспортный дизель.**

В рамках данного совместного с ЗАО «СПбМТСБ» проекта планируется продолжать активную работу по совершенствованию механизмов исполнения контракта. Кроме того,



предполагается внедрение нового сервисного механизма, позволяющего участникам осуществлять перенос позиций на серию фьючерса с более поздней датой экспирации (Rollover).

Для осуществления маркетинговой поддержки проекта РДК (ЗАО) планирует создание сайта компании на английском языке, подготовку ряда маркетинговых материалов по проекту на русском и английском языках, а также участие в организации и проведении различных маркетинговых мероприятий с целью ознакомления потенциальных участников рынка экспортной нефти и экспортного дизеля с технологиями клиринга РДК (ЗАО), участие в конференциях, лекциях и семинарах, проводимых в рамках проекта.

▪ **Расширение линейки товарных фьючерсов. Увеличение времени проведения торгов.**

В рамках данной задачи РДК (ЗАО) принимает участие в разработке следующих новых расчетных фьючерсных контрактов:

- она нефть BRENT, в качестве цены исполнения будет приниматься значение ICE Brent Index;
- она газойль, в качестве цены исполнения будет приниматься значение ICE Gasoil Index;
- она курс доллар США – российский рубль.

Данные инструменты позволят хеджировать валютные риски, связанные с экспортными торгами нефтью и дизелем, использовать арбитражные стратегии между торговыми площадками ЗАО «СПБМТСБ» и ICE.

Одновременно с началом торгов новыми инструментами ЗАО «СПБМТСБ» предполагает значительно увеличить продолжительность торгов в Секции срочного рынка для предоставления полноценной возможности участия в торгах нерезидентам, а также в целях привлечения участников, использующих различные арбитражные и спекулятивные стратегии.

▪ **Развитие систем автоматического тестирования.**

В процессе развития и совершенствования клиринговой системы срочного рынка первоочередной становится задача увеличения надежности программного обеспечения. В связи с этим РДК (ЗАО) в 2015 году будет продолжать совершенствовать систему автоматического тестирования программного обеспечения. Это позволяет значительно ускорить процесс тестирования без ущерба для результата, проводить тестирование с большей точностью, а в конечном итоге, значительно повысить качество программного обеспечения.

## **4.2. Депозитарная деятельность**

В 2016 году в связи с существенными изменениями в законодательстве об акционерных обществах и о рынке ценных бумаг, которые предписывают, начиная с 1 июля 2016 года, совершать ряд действий по реализации прав на ценные бумаги только через номинальных держателей и только в электронном виде, полностью отказавшись от бумажной документации, РДК (ЗАО) продолжит необходимые доработки нормативной и технологической базы депозитария для поддержания его нормативно-технологического обеспечения в актуальном состоянии.

В этой связи, в числе первоочередных задач, которые РДК (ЗАО) как депозитарий ставит перед собой в 2016 году, можно выделить следующие:

- сохранение позиций современного конкурентоспособного депозитария России;
- совершенствование депозитарных технологий в целях взаимодействия с участниками рынка ценных бумаг при проведении корпоративных действий;
- развитие депозитарных технологий в соответствии с изменениями действующего законодательства;
- дальнейшее проведение действий согласно Политики соответствия требованиям FATCA РДК (ЗАО);
- развитие клиентского сервиса кастодиального депозитария, расширение спектра оказываемых услуг;
- обеспечение эффективного взаимодействия с Центральным депозитарием;
- модернизация IT-инфраструктуры РДК (ЗАО) с целью повышения надежности, безопасности и удобства работы с системой депозитарного учета.

## **4.3. Информационно-технологическая деятельность и Удостоверяющий центр**

Информационно-технологическая деятельность РДК (ЗАО) в 2016 году традиционно будет связана с поддержанием высокого уровня надежности и безопасности предоставляемых клиентам РДК (ЗАО) сервисов, а также функциональных возможностей основных бизнес-приложений.

Будут проведены работы по плановой замене устаревающего оборудования на более современное и производительное, работы по развитию сетевой инфраструктуры компании, модернизации хранилищ данных, развитию систем мониторинга состояния оборудования и программного обеспечения.

В первой половине 2016 года планируется ввод в эксплуатацию третьего резервного канала связи от провайдера РетнНет, связывающего офис РДК (ЗАО) и резервный дата-

центр.

В этот же период планируется ввод в эксплуатацию сервиса «Личный кабинет» для клиентов и партнеров компании, что позволит оптимизировать прием поступающей от них информации.

Также Обществу предстоит осуществить техническую реализацию электронного документооборота с депонентами РДК (ЗАО) в целях выполнения требований Федерального закона «О рынке ценных бумаг».

В течение 2016 года планируется ввод в эксплуатацию нового комплекса виртуальной инфраструктуры, что позволит удобнее размещать новые сервисы как внутренней разработки, так и сервисы сторонних поставщиков (многочисленные системы отчетности, системы ЭДО и другие).

Кроме того, предполагается дальнейшее развитие основных бизнес приложений, обусловленных как требованиями рыночных подразделений по развитию бизнеса, так и запросами клиентов. Будут вестись работы по более глубокой интеграции всех бизнес приложений с целью обеспечения сквозной обработки данных, что позволит снизить операционные риски и повысить производительность труда.

Также в течение года будет проводиться подготовка к переходу с 1 января 2018 года на новый план счетов некредитных финансовых организаций, что может быть связано с серьезными изменениями в составе используемого бухгалтерского ПО.

В части внутренней разработки программного обеспечения основным проектом в течение года будет проектирование и реализация процедур автоматической предобработки и исполнения поручений, поданных участниками клиринга посредством сервиса WebOffice РДК. Большинство таких документов имеют стандартные форматы и представлены данными в формате xml. Автоматизация их обработки позволит в значительной степени разгрузить операционные подразделения компании.

Основное направление работ Удостоверяющего центра на 2016 год: развитие систем автоматизации Удостоверяющего центра с целью минимизации постоянного роста объемов операторской работы, связанной с постоянным увеличением количества Участников ЭДО.

#### **4.4. Управление рисками**

Среди основных приоритетных задач в 2016 году в части **развития системы управления рисками РДК (ЗАО)** выделяет следующие проекты:

##### **1) Приведение деятельности РДК (ЗАО) по управлению рисками в соответствие требованиям законодательства и Банка России**

В связи с принятием изменений в Федеральный закон «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» планируется разработка проектов Методики оценки точности модели центрального контрагента, Методики определения выделенного

капитала центрального контрагента, Плана восстановления финансовой устойчивости центрального контрагента и Правил защиты и раскрытия информации центральным контрагентом. Также запланировано формирование нового состава Комитета по риск-менеджменту в связи с новыми требованиями Банка России к составу его участников.

В соответствии с требованиями нормативных актов Банка России, а также Политики управления рисками РДК (ЗАО), утвержденной Советом директоров (протокол СД-13/2015 от 20 октября 2015 года), в 2016 году планируется совершенствование процесса предоставления регулярной отчетности по рискам органам управления РДК (ЗАО).

В целях дальнейшего совершенствования системы управления рисками с использованием лучших мировых практик и требований Банка России планируется актуализация Политики управления рисками РДК (ЗАО).

## **2) Совершенствование регулярных процедур управления рисками при осуществлении клиринговой деятельности**

Планируется к реализации в целях повышения качества управления рисками:

- совершенствование процедур стресс-тестирования системы управления рисками;
- совершенствование методологии расчёта ставок обеспеченности на рынке биржевых товаров;
- совершенствование принципов процедур принудительной ликвидации позиций и процедур урегулирования ситуации несостоятельности, в том числе в части порядка использования средств коллективного гарантийного фонда и гарантийного фонда Клиринговой организации.

## **3) Управление рисками в рамках проекта «Создания маркерных сортов российской нефти и нефтепродуктов»**

Работа над проектом проводится под эгидой Министерства энергетики Российской Федерации, в рамках реализации данного проекта планируется разработка требований к контролю финансового состояния иностранных участников клиринга, внесение изменений в Методику определения параметров гарантийной системы РДК (ЗАО) на срочном рынке ЗАО «СПбМТСБ». Также запланировано проведение всех необходимых мероприятий по подготовке к запуску торгов сопутствующими фьючерсными контрактами.

## **4) Совершенствование базы данных о случаях реализации рисков**

С целью повышения уровня автоматизации анализа, оценки и управления рисками, а также с целью приведения системы сбора данных в соответствие с требованиями

нормативных актов Банка России, а также Политики управления рисками РДК (ЗАО), планируется доработка специализированной базы данных (БД СУР), в которой производится фиксация информации обо всех существенных случаях реализации рисков.

**5) Развитие системы ключевых показателей деятельности и ключевых индикаторов рисков** (далее – КПД и КИР соответственно)

В целях мониторинга и своевременного реагирования на повышение уровня рисков в 2016 году планируется разработка функциональных требований по созданию, процедурам наполнения, хранения и использования БД КПД и КИР РДК (ЗАО).

**6) Совершенствование системы риск-ориентированного анализа бизнес-процессов**

С целью визуализации процессов, а также выявления сопутствующих рисков планируется разработка модели (технологических схем) бизнес-процессов РДК (ЗАО).

**7) Повышение корпоративной культуры управления рисками**

В 2016 году планируется проведение обучения руководителей подразделений РДК (ЗАО) по вопросам сбора данных о событиях риска, работы в БД СУР, проведение разъяснительной работы и консультаций в целях повышения дисциплины и качества собираемых данных о рискованных событиях.

## 5. Основные сведения о Закрытом акционерном обществе «Расчетно-депозитарная компания»

<b>Полное/сокращенное наименование</b>	Закрытое акционерное общество «Расчетно-депозитарная компания» / РДК (ЗАО)
<b>Наименование на английском языке (полное/ сокращенное)</b>	Settlement depository company (Closed Joint Stock Company) / SDCO (CJSC)
<b>Местонахождение</b>	115419, г. Москва, 2-й Верхний Михайловский пр-д, д.9, стр.2
<b>Почтовый адрес</b>	115419, г. Москва, 2-й Верхний Михайловский пр-д, д.9, стр.11
<b>Телефон/Факс</b>	(495) 380-13-26
<b>Официальный Интернет-сайт</b>	<a href="http://www.sdco.ru">www.sdco.ru</a>
<b>Адрес электронной почты</b>	<a href="mailto:office@sdco.ru">office@sdco.ru</a>
<b>Начало деятельности</b>	22 апреля 1998 года
<b>Сведения о государственной регистрации</b>	Общество зарегистрировано Московской регистрационной палатой 04 июля 2000 года № 072.010 ОГРН 1027739057840 от 09 августа 2002 года, регистрирующий орган - Межрайонная инспекция МНС РФ № 39 по г. Москве
<b>Сведения о лицензиях:</b>	
<b>Лицензия на осуществление депозитарной деятельности на рынке ценных бумаг</b>	Лицензия ФСФР России № 177-05282-000100 от 19 июня 2001 года, выдана без ограничения срока действия.
<b>Лицензия на осуществление клиринговой деятельности</b>	Лицензия ФСФР России № 077-00001-000010 от 11 декабря 2012 года, выдана без ограничения срока действия.
<b>Лицензия Центра по лицензированию, сертификации и защите государственной тайны ФСБ России</b>	Лицензия на осуществление разработки, производства, распространения шифровальных (криптографических) средств, информационных систем и

телекоммуникационных систем, защищенных с использованием шифровальных (криптографических) средств, выполнения работ, оказания услуг в области шифрования информации, технического обслуживания шифровальных (криптографических) средств, информационных систем и телекоммуникационных систем, защищенных с использованием шифровальных (криптографических) средств (за исключением случая, если техническое обслуживание шифровальных (криптографических) средств, информационных систем и телекоммуникационных систем, защищенных с использованием шифровальных (криптографических) средств, осуществляется для обеспечения собственных нужд юридического лица или индивидуального предпринимателя). Серия ЛСЗ № 009564 Рег.№13222Н от 22 октября 2013 года.

#### **Сведения о независимых аудиторах**

Аудиторская фирма «АЕМ-Аудит»  
Лицензия ГТ № 0079976, регистрационный номер 26047 от 31 марта 2015 года УФСБ России по городу Москве и Московской области на проведение работ, связанных с использованием сведений, составляющих государственную тайну. Срок действия лицензии до 13 октября 2019 года.  
Свидетельство о членстве № 869 в саморегулируемой организации «Некоммерческое партнерство «Аудиторская Палата России» ОРНЗ 10301003673 дата включения в реестр 28 декабря 2009 года.  
Общество с ограниченной ответственностью «ФБК ФИНАНС»  
Свидетельство о членстве № 7021 в саморегулируемой организации аудиторов «Некоммерческое партнерство «Аудиторская Ассоциация Содружество» ОРНЗ 11406012265, дата включения в реестр 21 апреля 2014 года.

**Сведения о членстве в  
профессиональных объединениях**

Профессиональная ассоциация регистраторов,  
трансфер-агентов и депозитариев (ПАРТАД).

Международная ассоциация бирж стран  
Содружества Независимых Государств  
(МАБ СНГ).