



Санкт-Петербургская
ВАЛЮТНАЯ БИРЖА



ГОДОВОЙ ОТЧЕТ

Акционерного общества

"Санкт-Петербургская Валютная Биржа"

за 2020 год

Санкт-Петербург
2021

УТВЕРЖДЕН
решением Совета директоров
Акционерного общества
«Санкт-Петербургская
Валютная Биржа»
(протокол от 31.05.2021 г. № 354)

СОДЕРЖАНИЕ

1. ОБЩАЯ ИНФОРМАЦИЯ	3
2. ПОЛОЖЕНИЕ СПВБ СРЕДИ РОССИЙСКИХ БИРЖ.....	4
3. ПРИОРИТЕТНЫЕ НАПРАВЛЕНИЯ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ СПВБ В 2020 ГОДУ.....	7
4. ОСНОВНЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ СПВБ.....	9
4.1. ТОРГИ В СЕКЦИИ МЕЖБАНКОВСКОГО КРЕДИТНОГО РЫНКА	14
4.2. РЕПО С КОМИТЕТОМ ФИНАНСОВ САНКТ-ПЕТЕРБУРГА	15
4.3. БИРЖЕВЫЕ ТЕХНОЛОГИИ.....	16
4.4. ИНФОРМАЦИОННАЯ БЕЗОПАСНОСТЬ	18
5. ИНФОРМАЦИЯ ОБ ИСПОЛЬЗОВАННЫХ ВИДАХ ЭНЕРГЕТИЧЕСКИХ РЕСУРСОВ	19
6. ОБЪЯВЛЕННЫЕ (НАЧИСЛЕННЫЕ) ДИВИДЕНДЫ ПО АКЦИЯМ СПВБ.....	20
7. ОСНОВНЫЕ ФАКТОРЫ РИСКА, СВЯЗАННЫЕ С ДЕЯТЕЛЬНОСТЬЮ СПВБ.....	21
8. КРУПНЫЕ СДЕЛКИ И СДЕЛКИ, В СОВЕРШЕНИИ КОТОРЫХ ИМЕЛАСЬ ЗАИНТЕРЕСОВАННОСТЬ	28
9. КОРПОРАТИВНОЕ УПРАВЛЕНИЕ.....	29
10. ПЕРСПЕКТИВЫ РАЗВИТИЯ СПВБ	34
11. СВЕДЕНИЯ О СОСТАВЕ СОВЕТА ДИРЕКТОРОВ СПВБ.....	36
12. СВЕДЕНИЯ ОБ УПРАВЛЯЮЩЕМ.....	36
13. СВЕДЕНИЯ О СОСТАВЕ ПРАВЛЕНИЯ СПВБ.....	38
14. КРИТЕРИИ ОПРЕДЕЛЕНИЯ И РАЗМЕР ВОЗНАГРАЖДЕНИЯ ЧЛЕНОВ СОВЕТА ДИРЕКТОРОВ СПВБ И ЧЛЕНОВ ПРАВЛЕНИЯ СПВБ	39
15. Приложение 1. Годовая бухгалтерская (финансовая) отчетность СПВБ за период с 1 января по 31 декабря 2020 года	
16. Приложение 2. Аудиторское заключение о годовой бухгалтерской (финансовой) отчетности СПВБ за период с 1 января по 31 декабря 2020 года	
17. Приложение 3. Консолидированная финансовая отчетность СПВБ за год, закончившийся 31 декабря 2020 года	
18. Приложение 4. Аудиторское заключение о годовой консолидированной финансовой отчетности СПВБ за 2020 год	

1. ОБЩАЯ ИНФОРМАЦИЯ

Акционерное общество "Санкт-Петербургская Валютная Биржа" (далее - СПВБ) учреждено 21 мая 1992 года ведущими банками Санкт-Петербурга и Комитетом по внешним связям мэрии Санкт-Петербурга.

СПВБ имеет лицензии, позволяющие осуществлять клиринговую деятельность и деятельность по проведению организованных торгов на российском финансовом рынке.

Основные направления деятельности СПВБ:

- аукционы и вторичные торги облигациями субъектов Российской Федерации;
- торги корпоративными акциями и облигациями российских эмитентов;
- организация выпусков биржевых облигаций;
- проведение аукционов и торгов по размещению денежных средств на депозиты в уполномоченных банках;
- сделки РЕПО с Банком России с корзиной ценных бумаг;
- сделки РЕПО с Комитетом финансов Санкт-Петербурга с корзиной ОФЗ и сделки РЕПО с Комитетом финансов Ленинградской области с корзиной ценных бумаг;
- клиринговое обслуживание.

Расчетными организациями СПВБ являются Небанковская кредитная организация акционерное общество "Петербургский Расчетный Центр" (далее – НКО АО ПРЦ) и Небанковская кредитная организация акционерное общество "Национальный расчетный депозитарий" (далее - НКО АО НРД).

Расчетными депозитариями СПВБ являются НКО АО НРД и Закрытое акционерное общество "Санкт-Петербургский Расчетно-Депозитарный Центр" (далее – ЗАО РДЦ).

Клиринговое обслуживание участников торгов по заключенным на СПВБ сделкам на денежном рынке и рынке ценных бумаг осуществляет СПВБ, по сделкам прямого РЕПО с Банком России - НКО АО НРД.

2. ПОЛОЖЕНИЕ СПВБ СРЕДИ РОССИЙСКИХ БИРЖ

СПВБ осуществляет свою деятельность на территории Российской Федерации. Экономика Российской Федерации проявляет некоторые характерные особенности, присущие развивающимся рынкам.

С начала 2020 года вспышка коронавируса COVID-19 распространилась по всему миру, что повлияло на мировую экономику.

Вследствие данных событий, в 2020 году в Российской Федерации наблюдались существенные изменения в экономической среде:

- сокращение промышленного производства и деловой активности во многих отраслях экономики в результате введенных государством ограничений, связанных с мерами по сдерживанию развития пандемии COVID-19;
- предоставление мер государственной поддержки населению и бизнесу, связанных с развитием пандемии COVID-19;
- высокая волатильность и снижение биржевых индексов, цен на нефть;
- значительное снижение активности на биржевом рынке и срочном рынке.

Действие указанных факторов способствовало экономическому спаду в стране, характеризующемуся падением показателя валового внутреннего продукта. Финансовые рынки по-прежнему характеризуются отсутствием стабильности, частыми и существенными изменениями цен, увеличением спредов по торговым операциям, снижению временно свободных денежных средств вкладчиков, размещающих их на СПВБ.

Экономическая среда оказывает значительное влияние на деятельность и финансовое положение СПВБ. Акционеры и руководство СПВБ принимают все необходимые меры для обеспечения устойчивости деятельности СПВБ.

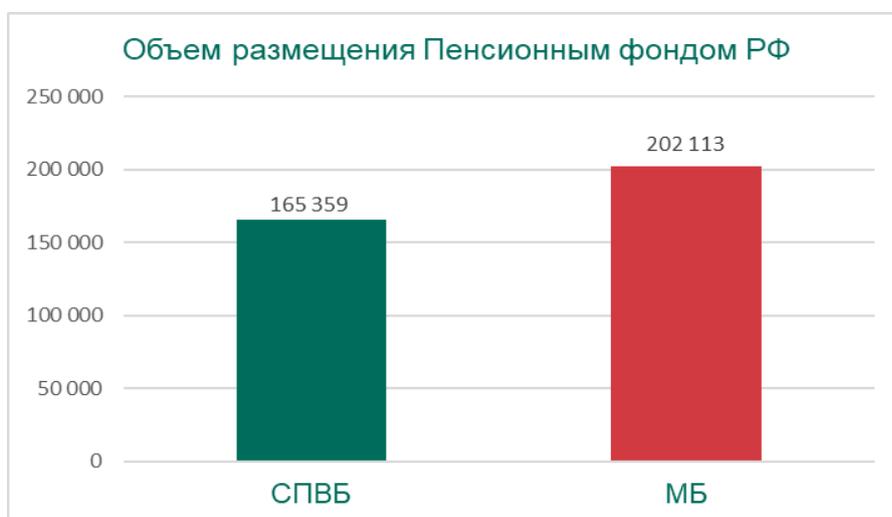
Показатель	2019 г	2020 г	2020/2019
Объем торгов, млн.руб.	2 476 590	9 012 930	364%
Операционные доходы, млн.руб.	273	321	118%
Рентабельность по EBITDA, %	32%	29%	91%
Чистая прибыль, млн.руб.	77,765	77,892	100%
CIR, %	67%	72%	107%
Прибыль на акцию, тыс. руб.	46	46	100%

Несмотря на то, что российский биржевой рынок практически консолидирован Публичным акционерным обществом «Московская Биржа ММВБ-РТС» (далее – МБ), СПВБ добилась в 2020 году существенных результатов.

Данные о проведении отбора заявок Федерального казначейства и Пенсионного фонда РФ на банковские депозиты через СПВБ и МБ в 2020 г

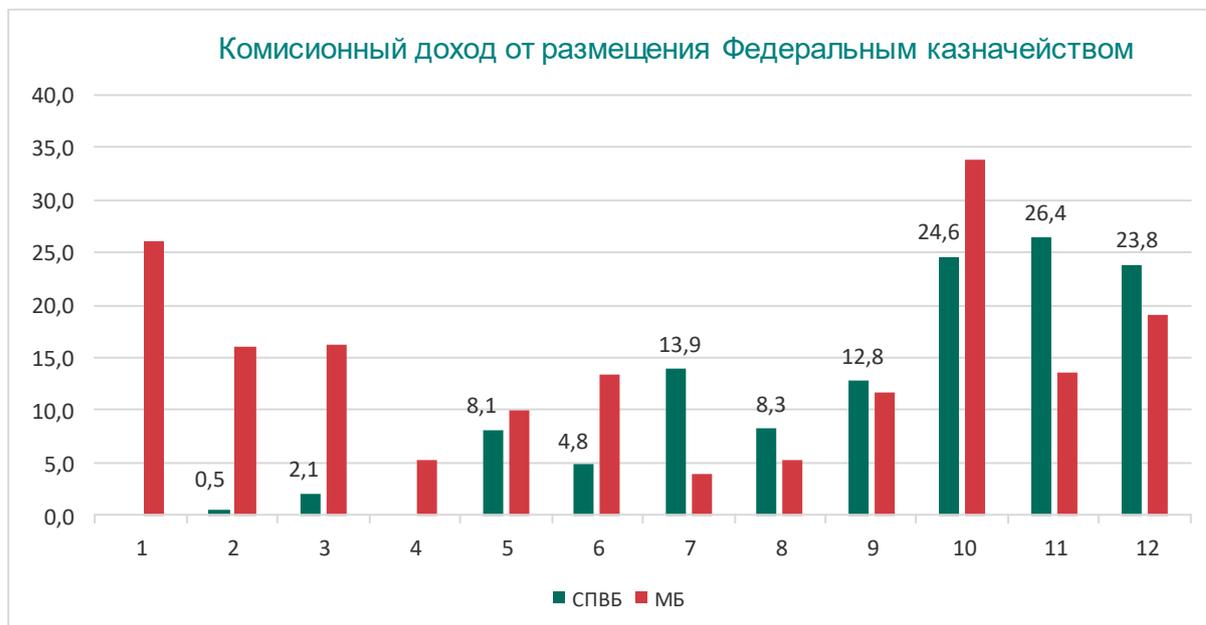
(млн.руб.)

Организатор	СПВБ		МБ	
	Объем	Комиссия	Объем	Комиссия
Федеральное казначейство	6 503 591	125	6 663 193	175
Пенсионный фонд РФ	165 359	13	202 113	15



Сравнение объема и комиссионного дохода по результатам проведения отбора заявок Федерального казначейства на депозиты через СПВБ и МБ в 2020 году:

Период	Объем, млрд. руб.			Комиссия, млн.руб.		
	СПВБ	МБ	Доля СПВБ, %	СПВБ	МБ	Доля СПВБ, %
янв.20	0	536		0	26,0	0
фев.20	7	330	2%	0,5	16,1	3%
мар.20	57	584	9%	2,1	16,2	12%
апр.20	0	595	0%	0,0	5,3	0%
май.20	851	572	60%	8,1	10,1	45%
июн.20	325	290	53%	4,8	13,4	26%
июл.20	420	140	75%	13,9	3,9	78%
авг.20	410	190	68%	8,3	5,3	61%
сен.20	545	420	56%	12,8	11,8	52%
окт.20	1 350	1 380	49%	24,6	33,9	42%
ноя.20	1 390	600	70%	26,4	13,7	66%
дек.20	1 150	1 026	53%	23,8	19,0	56%
ИТОГО	6 504	6 663	49%	125,4	174,7	42%



3. ПРИОРИТЕТНЫЕ НАПРАВЛЕНИЯ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ СПВБ В 2020 ГОДУ

Приоритетным направлением деятельности СПВБ в 2020 году являлась организация торгов на биржевом денежном рынке (депозитные сделки).

Помимо этого, с использованием информационных программно-технических средств СПВБ осуществлялся отбор заявок кредитных организаций для заключения договоров прямого РЕПО с Банком России и РЕПО с Комитетом финансов Санкт-Петербурга.

СПВБ также осуществляла клиринговое обслуживание участников торгов по заключенным на СПВБ сделкам и деятельность удостоверяющего центра.

ОСНОВНЫЕ СОБЫТИЯ 2020 ГОДА

20 февраля 2020 года в СПВБ состоялось размещение биржевых облигаций РОССИЙСКОГО НАЦИОНАЛЬНОГО КОММЕРЧЕСКОГО БАНКА (публичное акционерное общество).

28 февраля 2020 года Федеральное казначейство начало проведение отбора заявок и заключение договоров банковского депозита по размещению средств Федерального бюджета в кредитных организациях с использованием информационных программно-технических средств СПВБ.

16 апреля 2020 года СПВБ зарегистрирован выпуск биржевых облигаций бездокументарных процентных неконвертируемых с обязательным централизованным учетом прав серии 01 Открытого акционерного общества «Московская телекоммуникационная корпорация» (ОАО «КОМКОР»), выпуску присвоен регистрационный номер 4B03-01-16104-H от 16.04.2020.

Указанные биржевые облигации включены в Список ценных бумаг, допущенных к торгам в фондовой секции СПВБ, с внесением в некотировальную часть Списка ценных бумаг раздела «Ценные бумаги, допущенные к размещению».

С 25 мая 2020 года участникам, допущенным к торгам в фондовой секции СПВБ предоставлена возможность участия в аукционах на заключение сделок РЕПО в рублях с корзиной GCOLLATERAL с клирингом и расчетами в НКО АО НРД, сроком на один месяц с фиксированной ставкой в течение срока сделки РЕПО.

С 22 июня 2020 года на СПВБ реализованы аукционы на заключение сделок РЕПО в рублях с корзиной GCOLLATERAL с клирингом и расчетами в НКО АО НРД, сроком на один год с плавающей ставкой в течение срока сделки РЕПО, привязанной к ключевой ставке Банка России.

11 сентября 2020 года между СПВБ и Комитетом финансов Ленинградской области заключен договор о взаимодействии при осуществлении операций РЕПО с использованием информационных программно-технических средств СПВБ.

11 ноября 2020 года СПВБ принято решение о регистрации Программы биржевых облигаций Публичного акционерного общества «Промсвязьбанк» серии 001Р и присвоении регистрационного номера 403251В001Р03Е (максимальная сумма номинальных стоимостей биржевых облигаций, которые могут быть размещены в рамках Программы биржевых облигаций - 200 000 000 000 (Двести миллиардов) российских рублей).

4. ОСНОВНЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ СПВБ

В 2020 году доходы составили 320,6 млн. руб., что на 18% превышает значение 2019 года.

Доля комиссионного дохода в структуре операционных доходов достигла рекордных 83% по итогам 2020 года.

За 2020 г. комиссионные доходы СПВБ выросли на 33% до уровня 267 млн. рублей, за счет роста объема торгов на денежном рынке.

Процентные доходы снизились на 18% на фоне снижения процентных ставок.

Ключевые финансовые показатели СПВБ

(тыс.руб.)

Статьи доходов и расходов	2018 г	2019 г	2020 г	2020/2019
Доходы	196 008	272 675	320 621	118%
Комиссионные доходы	142 990	200 252	266 524	133%
Процентные доходы	32 615	40 260	33 058	82%
Прочие доходы			1 033	
Дивиденды полученные	20 403	32 163	20 006	62%
Расходы	-148 078	-181 733	-230 926	127%
Расходы на персонал	-96 930	-120 965	-134 265	111%
АХР, в т.ч.:	-50 072	-51 640	-43 761	85%
<i>расходы на амортизацию</i>	<i>-575</i>	<i>-15 486</i>	<i>-18 432</i>	<i>119%</i>
Прочие расходы	-1 076	-1 057		
Целевые расходы на развитие ИТ и ИБ			-44 694	
ЕБИТДА	15 977	74 352	83 275	112%
Рентабельность по ЕБИТДА, %	10%	32%	29%	91%
Прямые операционные расходы	-87	-113	-99	88%
Процентные расходы		-8 071	-8 107	100%
Финансовый результат до налога	47 930	90 942	89 695	99%
<i>налог на прибыль</i>	<i>-601</i>	<i>-13 176</i>	<i>-11 804</i>	<i>90%</i>
Чистая прибыль	47 329	77 766	77 891	100%

Несмотря на снижение тарифа в 2020 году для некоторых организаторов депозитных аукционов (более чем в 3 раза - с 0,00065% до 0,0002%) общая сумма комиссионного дохода от операций на денежном рынке в 2020 году превысила результат 2019 года на 66 млн.руб. (38%) за счет существенного роста объема торгов.

Перевыполнение плана по доходам и небольшая экономия относительно запланированных расходов в 2020 году привело к выполнению плана по финансовому результату на 292%, чистая прибыль по итогам 2020 года составила **77,9 млн. руб.**

Чистая прибыль сохранилась на уровне 2019 года несмотря на рост операционных расходов.

Динамика чистой прибыли СПВБ

(млн.руб.)

Период (год)	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020
Чистая прибыль	23,2	49,3	50,4	10,1	47,3	77,8	77,9



Итоги торгов на СПВБ в 2020 году

(млрд. руб.)

Объем торгов	2018 г	2019 г	2020 г	2020/2019
Объем депозитных сделок	1 338,02	2 389,54	8 913,23	373%
Объем торгов ценными бумагами	1,19	0,0001	4,38	-
Объем договоров РЕПО, в т.ч.:	-	87,05	95,32	110%
РЕПО с КФ СПб	-	87,05	95,30	
РЕПО с ЦБ	-	-	0,02	

Объем депозитных сделок, заключенных на СПВБ в 2020 году, составил 8 913,23 млрд. руб., что превышает почти в 4 раза объем 2019 года.



Объем торгов ценными бумагами на СПВБ в 2020 году составил 4,375 млрд. руб., продемонстрировав значительный рост по сравнению с 2019 годом - 0,105 млн. руб.

Объем договоров РЕПО на корзину ценных бумаг, заключенных с кредитными организациями с использованием информационных программно-технических средств СПВБ в 2020 году, составил 95,32 млрд. руб., что на 10% превышает объем 2019 года в сумме 87,05 млрд. руб.

Членами секций СПВБ на 31 декабря 2020 года являлись:

- в секции межбанковского кредитного рынка – 39 кредитных организаций,
- в фондовой секции - 30 кредитных организаций и инвестиционных компаний.

Динамика объема депозитных сделок, заключенных на СПВБ

(млн. руб.)

Организатор	2018 г	2019 г	2020 г	2020/2019
Комитет Финансов СПб	927 955	1 844 550	1 842 700	100%
Фонд ЖКХ	19 600	146 100	186 720	128%
Фонд СКМБ	16 068	19 895	28 961	146%
Федеральное казначейство	0	0	6 503 591	-
ФАУ Главгосэкспертиза	83 000	65 700	53 600	82%
Комитет Финансов Лен.Обл.	159 900	139 800	132 300	95%
Пенсионный Фонд РФ	131 500	173 495	165 359	95%
ИТОГО	1 338 023	2 389 540	8 913 231	373%

Существенный прирост совокупного объема торгов на СПВБ вызван размещением средств федерального бюджета на банковские депозиты, осуществленным Федеральным казначейством в сумме 6 504 млрд. руб. по итогам 2020 г.

Федеральное казначейство проводит отбор заявок по размещению средств федерального бюджета на банковских депозитах в кредитных организациях с использованием информационных программно-технических средств СПВБ с февраля 2020 г. Оформление договоров банковского депозита осуществляется путем обмена электронными документами посредством Системы электронного документооборота НКО АО НРД.

По результатам 2020 года прирост также наблюдается по объему размещения на депозиты государственной корпорации Фонда содействия реформированию жилищно-коммунального хозяйства (28%) и некоммерческой организации «Фонд содействия кредитованию малого и среднего бизнеса, микрокредитная компания» (46%).

Распределение объема размещения на СПВБ на депозиты в 2020 году

Организатор	Объем, млн.руб.	Доля, %
Комитет Финансов СПб	1 842 700	21%
Фонд ЖКХ	186 720	2%
Фонд СКМБ	28 961	0,02%
Федеральное казначейство	6 503 591	73%
ФАУ Главгосэкспертиза	53 600	1%
Комитет Финансов Лен.Обл.	132 300	1%
Пенсионный Фонд РФ	165 359	2%
ИТОГО	8 913 231	100%

Основная доля размещения на денежном рынке приходится на Федеральное казначейство и составляет 73% от общего объема.



Динамика комиссионных доходов

(тыс. руб.)

№ п/п	Статьи доходов	2019 г	2020 г	2020/2019
	Комиссионные доходы, в т.ч.:	200 252	266 524	133%
1.	от операций на фондовом рынке	-	911	-
2	от операций на денежном рынке, в т.ч.:	175 860	241 876	138%
2.1.	Комитет Финансов СПб	54 566	24 542	45%
2.2.	Фонд ЖКХ	17 462	27 653	158%
2.3.	Фонд СКМБ	9 038	11 239	124%
2.4.	Федеральное Казначейство	0	125 391	-
2.5.	ФАУ Главгосэкспертиза	7 101	6 684	94%
2.6.	Комитет Финансов Лен. Обл.	73 391	33 461	46%
2.7.	Пенсионный Фонд РФ	14 304	12 906	90%
3.	от оказания услуг по допуску РЕПО	1 386	2 355	170%
4.	от клирингового обслуживания	17 459	15 746	90%
5	от оказания услуг, в т.ч.:	5 545	5 636	102%
5.1.	услуги листинга	1 250	1 180	94%
5.2.	предоставление тех. доступа к ТС СПВБ	1 732	2 068	119%
5.3.	прочие услуги (SWIFT, ЭЦП и др.)	2 563	2 388	93%

Динамика процентных доходов

№ п/п	Статьи доходов	2019 г	2020 г	2020/2019
	Процентные доходы, в т.ч.:	40 260	33 058	82%
1.	проценты по депозитам	38 116	30 221	79%
2.	проценты по выданным займам	2 144 (за 6 мес)	2 837	

Процентные доходы в 2020 году составили 33 млн. рублей, что ниже результатов 2019 года и напрямую связано со снижением в 2020 году ключевой ставки Банка России.

4.1. ТОРГИ В СЕКЦИИ МЕЖБАНКОВСКОГО КРЕДИТНОГО РЫНКА

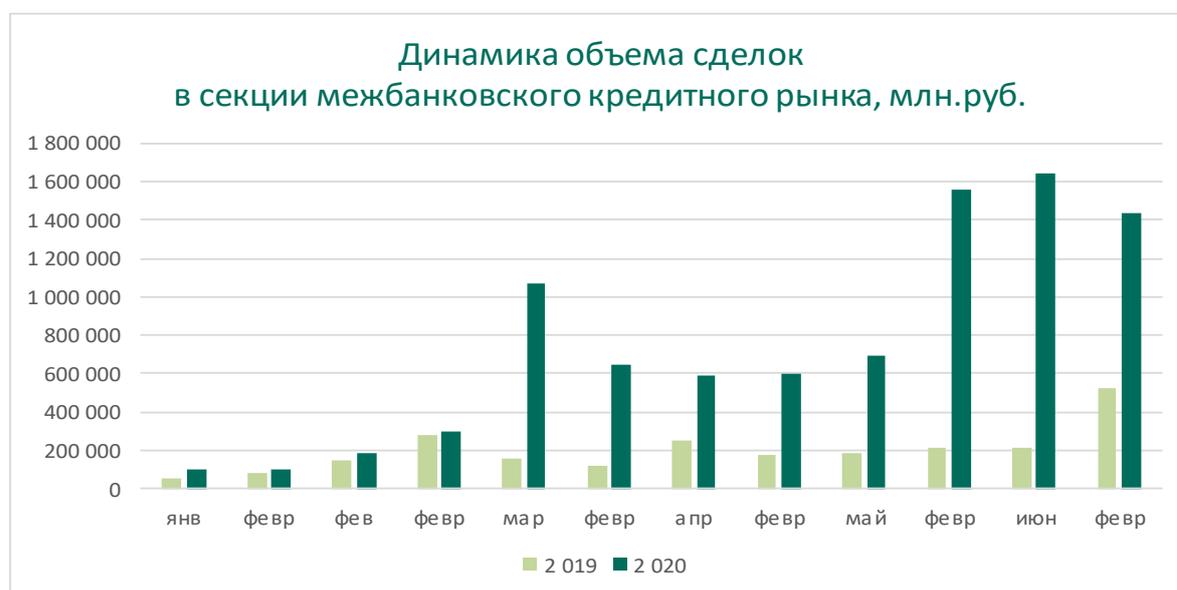
В 2020 году на СПВБ проводились аукционы и торги по размещению на банковские депозиты в уполномоченных банках денежных средств бюджета Санкт-Петербурга, бюджета Ленинградской области, Фонда ЖКХ, Пенсионного фонда Российской Федерации, ФАУ "Главгосэкспертиза России", некоммерческой организации "Фонд содействия кредитованию малого и среднего бизнеса, микрокредитная компания" и Федерального казначейства.

В таблице показан объем депозитных сделок на СПВБ за 2020 год

(млн.руб.)

Период	Комитет финансов СПб	Фонд ЖКХ	Фонд СКМБ	ПФ РФ	Комитет финансов Ленинградской обл	ФАУ Главгосэкспертиза	Федеральное казначейство	Итого
янв.20	81 000	0	0	2 560	5 700	6 100	0	95 360
фев.20	78 700	600	3 535	0	5 100	7 000	6 500	101 435
мар.20	91 000	30 000	0	0	8 100	2 600	57 000	188 700
апр.20	272 500	0	0	800	24 600	3 500	0	301 400
май.20	164 000	20 400	4 714	0	18 300	5 800	851 000	1 064 214
июн.20	145 000	10 000	922	156 850	3 300	0	324 530	640 602
июл.20	126 000	17 850	2 547	590	11 100	6 800	420 000	584 887
авг.20	150 500	18 370	5 790	430	9 600	2 600	410 000	597 290
сен.20	122 000	9 950	1 200	744	4 800	6 900	545 000	690 594
окт.20	184 500	2 500	1 300	385	20 700	2 600	1 349 561	1 561 546
ноя.20	182 000	51 200	4 332	350	8 400	3 800	1 390 000	1 640 082
дек.20	235 500	24 750	4 272	2 650	12 600	5 900	1 150 000	1 435 672
Итого	1 832 700	185 620	28 612	165 359	132 300	53 600	6 503 591	8 901 782

Динамика объема депозитных сделок на СПВБ



4.2. ДОГОВОРА РЕПО

В 2020 году Комитет финансов Санкт-Петербурга осуществлял отбор заявок (оферт) и заключение договоров РЕПО (акцепт оферт) на внебиржевом рынке с использованием информационных программно-технических средств СПВБ.

Расчеты по денежным средствам и ценным бумагам, клиринг и управление обеспечением осуществлялось НКО АО НРД.

Объем договоров РЕПО на СПВБ в 2020 году

(млрд. руб.)

Объем	2019 г	2020 г	2020/2019
Объем договоров РЕПО, в т.ч.:	87,05	95,32	110%
<i>РЕПО с КФ СПб</i>	87,05	95,30	109,5%
<i>РЕПО с ЦБ</i>	-	0,02	

Объем договоров РЕПО Комитета финансов Санкт-Петербурга на корзину ценных бумаг, заключенных с кредитными организациями с использованием информационных программно-технических средств СПВБ, в 2020 году составил 95,30 млрд. руб., на 9,5% превысив объем заключенных договоров РЕПО в 2019 году - 87,05 млрд. руб.

Объем договоров РЕПО Банка России на корзину ценных бумаг, заключенных с кредитными организациями на СПВБ в 2020 году, составил 0,020 млрд. руб.

В 2020 году на СПВБ реализованы аукционы на заключение сделок РЕПО в рублях с корзиной GCOLLATERAL:

- сроком на один месяц с фиксированной ставкой в течение срока сделки РЕПО.
- сроком на один год с плавающей ставкой в течение срока сделки РЕПО, привязанной к ключевой ставке Банка России.

В 3 квартале 2020 года между СПВБ и Комитетом финансов Ленинградской области заключен договор о проведении операций РЕПО с использованием информационных программно-технических средств СПВБ.

4.3. БИРЖЕВЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

Основными целями развития биржевых технологий в 2020 году на СПВБ являлись:

- обеспечение функционирования существующих сегментов рынков;
- адаптация функционала к изменяющимся бизнес-требованиям;
- реализация функционала для новых сегментов существующих рынков.

Разработка, техническая поддержка, развитие программного обеспечения действующих торговой, расчетной, клиринговой систем и подсистемы электронного документооборота, используемой при проведении операций размещения депозитов Пенсионного Фонда Российской Федерации, а также обеспечение функционирования и выдачи сертификатов УЦ СПВБ, поддержка ИОК для Торгово-Клиринговой Системы СПВБ и РС НКО АО ПРЦ производится сотрудниками СПВБ.

В 2020 году на СПВБ осуществлялись доработки программного обеспечения торговой и клиринговой систем СПВБ, связанные с изменениями тарифов, форм финансовых документов, лимитных схем и т.п., а также поддержка эксплуатации расчетной системы НКО АО ПРЦ.

Реализован дополнительный функционал программной части действующей ИТ-платформы:

на фондовом рынке для

- размещения и выкупа биржевых облигаций РНКБ Банк (ПАО);
- проведения операций РЕПО на корзину ценных бумаг в НКО АО НРД были осуществлены доработки для обеспечения возможности постановки заявок и их удовлетворения с точностью до четвертого знака после запятой, а также осуществление сделок с плавающей ставкой для сегментов РЕПО Банка России и РЕПО Комитета финансов Санкт-Петербурга;
- проведения операций РЕПО с Комитета финансов Ленинградской области на корзину ценных бумаг в НКО АО НРД.

на денежном рынке для

- проведения отбора заявок Федерального казначейства на банковские депозиты, включая разработку модуля подсистемы выгрузки/загрузки документов в согласованных XML форматах;
- изменения схемы размещения депозитов Пенсионного фонда Российской Федерации, включая доработки подсистемы электронного документооборота, предназначенной для взаимодействия с Пенсионным фондом Российской Федерации.

В период пандемии коронавируса была обеспечена работа сотрудников СПВБ, переведённых на удалённый режим работы. В целях организации удалённой работы сотрудников был развёрнут сервер удалённого доступа с двухфакторной аутентификацией.

В течение 2020 года обновлялось сетевое оборудование СПВБ в целях соответствия возрастающим требованиям к скорости и надёжности работы локальной сети.

В рамках модернизации сетевой инфраструктуры СПВБ были закуплены и введены в эксплуатацию 2 коммутатора ядра Eltex.

Осуществлялись мероприятия по повышению информационной безопасности биржевой инфраструктуры. Закуплено и развёрнуто сертифицированное антивирусное ПО «Kaspersky Endpoint Security». Организованы изолированные сегменты для сетей дочерних организаций, произведено обособление АРМ администраторов ТС. Повышена безопасность и управляемость парка компьютеров сотрудников СПВБ путём расширения доменных политик и модернизации версий ОС.

Закуплен и запущен в работу сервер для размещения программного комплекса 1С; комплекс 1С переведён в клиент-серверный режим работы, что позволило обеспечить стабильную и отказоустойчивую работу системы в многопользовательском режиме.

В 2020 году СПВБ внедрена информационная система для ведения учета и подготовки отчетности, состоящая из модулей «ХОМНЕТ:НФО» и «ХОМНЕТ:XBRL».

Программный продукт «ХОМНЕТ:НФО» ориентирован на решение следующих задач:

- автоматизация учёта в некредитных финансовых организациях по отраслевым стандартам Банка России (утв. Банком России 02.09.2015 №486-П);
- возможность учета операций с финансовыми инструментами, в том числе с ценными бумагами и ПФИ;
- возможность формирования управленческих форм отчетности.

Программный продукт «Хомнет:XBRL» предназначен для:

- подготовки полного пакета бухгалтерской и надзорно-статистической отчетности (БФО, НСО) в формате XBRL согласно таксономии, публикуемой Банком России;
- загрузки таксономии, публикуемой на сайте Банка России;
- осуществления валидации версии отчета на соответствие требованиям Банка России.

Автоматизированная загрузка информации в системе «Хомнет:XBRL» позволяет снизить уровень регуляторного риска.

4.4. ИНФОРМАЦИОННАЯ БЕЗОПАСНОСТЬ

Основной целью обеспечения информационной безопасности (далее - ИБ) СПВБ является защита интересов клиентов, сотрудников и акционеров СПВБ путем формирования условий, при которых будет обеспечена эффективная защита конфиденциальной информации от ненамеренного или преднамеренного вмешательства, потенциально способного привести к раскрытию, искажению, изменению, уничтожению и иным видам воздействия на информацию.

Ускорившиеся в 2020 году темпы цифровой трансформации финансового сектора предъявили новые требования к функционированию системы обеспечения информационной безопасности (далее – СОИБ) СПВБ, в том числе:

- определению требований к СОИБ СПВБ;
- организации мероприятий и координации работ подразделений СПВБ по ИБ в соответствии с Политикой ИБ СПВБ;
- планированию и контролю организационных и технических мероприятий по ИБ, в том числе обусловленных требованиями регулирующих органов.

В целях повышения текущей информационной безопасности отделом ИБ СПВБ в 2020 году разработаны основополагающие внутренние нормативные документы:

- Правила обеспечения информационной безопасности;
- Антивирусная политика;
- Правила предоставления удаленного доступа;
- Регламент управления правами доступа;
- Политика управления учетными записями;
- Карты доступа к Торговой системе и Клиринговой системе.

Отдел ИБ СПВБ в 2020 году разработал форму заявки на доступ к Торговой и Клиринговой системе и актуализировал действующие права доступа к Торговой и Клиринговой системе на базе ролевой модели доступа с документальным оформлением и наблюдением со стороны ИБ.

5. ИНФОРМАЦИЯ ОБ ИСПОЛЬЗОВАННЫХ ВИДАХ ЭНЕРГЕТИЧЕСКИХ РЕСУРСОВ

В 2020 году СПВБ использованы следующие виды энергетических ресурсов:

Вид ресурса	2019 год		2020 год	
	в натуральном выражении	в денежном выражении*	в натуральном выражении	в денежном выражении*
Электроэнергия	290 160 кВт*час	1 807 670 руб.	274 020 кВт*час	2 116 998 руб.
Бензин автомобильный	4 803 литров	181 175 руб.	2 779 литров	120 716 руб.
Топливо дизельное	6 562 литров	260 562 руб.	762 литров	36 834 руб.
Газ природный	11 929 кубических метров	67 740 руб.	11 200 кубических метров	77 959 руб.

* - Данные в денежном выражении приведены без НДС

В натуральном выражении наблюдается снижение использования энергетических ресурсов. Рост в денежном выражении электроэнергии и природного газа вызван увеличением тарифов на данные виды ресурсов.

Природный газ необходим для обеспечения работы газового котла, так как здание, в котором расположен офис СПВБ находится на автономном отоплении.

Электроэнергия использовалась для электроснабжения офиса и электрооборудования: бытовых приборов, офисной оргтехники и других специальных электроприборов. Учет потребляемой электроэнергии производился установленным электросчетчиком.

Бензин автомобильный и дизельное топливо использовались для заправки автомобилей, находящихся в собственности СПВБ и предназначенных для обеспечения служебных поездок, и доставки документов в контролирующие и надзорные органы, банки и иные учреждения города по служебной необходимости. Снижение расхода бензина автомобильного и дизельного топлива произошло в результате продажи двух служебных автомобилей в феврале и марте 2020 г. На данный момент используется один служебный автомобиль, работающий на автомобильном бензине.

6. ОБЪЯВЛЕННЫЕ (НАЧИСЛЕННЫЕ) ДИВИДЕНДЫ ПО АКЦИЯМ СПВБ

В соответствии с решением Годового Общего собрания акционеров СПВБ от 24 августа 2020 г. (Протокол № 43 от 26 августа 2020 г.) дивиденды по итогам 2019 финансового года не объявлялись, не начислялись и не выплачивались, а чистая прибыль по итогам деятельности СПВБ в 2019 году оставлена в распоряжении СПВБ.

7. ОСНОВНЫЕ ФАКТОРЫ РИСКА, СВЯЗАННЫЕ С ДЕЯТЕЛЬНОСТЬЮ СПВБ

Политика СПВБ в области управления рисками (принципы, цели, задачи и организационная структура) определяется Советом директоров СПВБ.

Принципы, элементы системы и методы управления рисками, порядок мониторинга и контроля за эффективностью системы управления рисками, органы, ответственные за ее функционирование и раскрытие информации о ней определены в Правилах организации системы управления рисками, связанными с осуществлением деятельности организатора торговли и клиринговой деятельности СПВБ, которые утверждаются Советом директоров СПВБ.

СПВБ рассматривает управление рисками как один из важнейших элементов стратегического управления. В процессе управления рисками СПВБ регулярно выявляет, оценивает и контролирует угрозы и возможности, адаптирует свою деятельность с целью уменьшения вероятности и потенциальных последствий угроз и с целью реализации возможностей.

Политика СПВБ в области управления рисками определяется характером и масштабом операций и исходит из принципа разумной достаточности. В рамках своей политики управления рисками СПВБ учитывает интересы акционеров, а также возможные последствия деятельности для других заинтересованных сторон.

Актуальная информация о рисках предоставляется органам управления СПВБ в форме ежемесячных и ежеквартальных отчетов.

СПВБ информирует акционеров и иных заинтересованных лиц о своей деятельности в области управления рисками. Соответствующий раздел включается в годовой отчет.

В целях эффективного контроля со стороны Совета директоров СПВБ за системой управления рисками создан Комитет по рискам и аудиту СПВБ, действующий на постоянной основе.

Организационная структура системы управления рисками СПВБ включает в себя:

- Совет директоров СПВБ;
- Комитет по рискам и аудиту СПВБ;
- Управляющего СПВБ;
- Правление СПВБ;
- Риск-менеджера;
- Контролера;
- Службу внутреннего аудита;
- Руководителей структурных подразделений, отвечающих за непосредственное управление рисками.

СПВБ как организатор торговли осуществляет управление следующими видами рисков:

- операционный риск;
- регуляторный риск;
- риск потери деловой репутации;
- стратегический риск;
- правовой риск;

СПВБ как клиринговая организация осуществляет управление следующими видами рисков:

- операционный риск;
- регуляторный риск;
- риск потери деловой репутации;
- кредитный риск;
- системный риск;
- рыночный риск;
- правовой риск;
- риск ликвидности;
- кастодиальный риск;
- коммерческий риск.

Операционный риск

Организация системы управления операционным риском осуществляется риск-менеджером, а непосредственное управление – структурными подразделениями СПВБ, участвующими в организации торгов и клиринговой деятельности.

СПВБ осуществляет тестирование программно-технических средств, используемых для осуществления деятельности по организации торговли и клиринговой деятельности, с периодичностью не реже одного раза в 6 месяцев.

СПВБ использует основной и резервный комплекс средств проведения торгов и клиринга, расположенные на территории Российской Федерации и снабженные альтернативными источниками электропитания.

Факты реализации операционного риска в 2020 году не зафиксированы.

Регуляторный риск

Управление регуляторным риском СПВБ осуществляется контролером на основании Правил внутреннего контроля.

СПВБ осуществляет мониторинг деятельности структурных подразделений и их работников в целях управления регуляторным риском и определения источников возникновения регуляторного риска. Контролируется соблюдение сроков представления отчетности в Банк России, соблюдение порядка и сроков раскрытия информации, требований к размеру, порядку и срокам расчета собственных средств СПВБ. Осуществляется контроль исполнения

предписаний Банка России. Ведется учет событий, связанных с регуляторным риском деятельности СПВБ.

Контролер информирует органы управления СПВБ о регуляторных рисках деятельности СПВБ.

В 2020 году зафиксированы факты реализации регуляторного риска, вызвавшие санкции со стороны регулятора. Регулятором вынесено Постановление о наложении административного взыскания от 31.12.2020 № Т2-31-3-8/38805.

Риск потери деловой репутации

В целях управления риском потери деловой репутации осуществляются следующие действия:

- сбор и анализ отзывов о СПВБ в средствах массовой информации;
- подготовка отчетов о фактах публикации негативных и позитивных отзывов о СПВБ для органов управления СПВБ;
- подготовка комментариев и опровержений недостоверной/порочащей информации о СПВБ.

Стратегический риск

Стратегия деятельности и развития СПВБ определяется Советом директоров СПВБ.

В целях управления стратегическим риском СПВБ при осуществлении долгосрочного планирования развития деятельности СПВБ органы управления СПВБ обязаны принимать во внимание эффективность системы управления рисками.

В рамках управления стратегическим риском СПВБ выявлены и контролируются риск концентрации на одном торговом сегменте (вероятность возникновения потерь в результате слишком большой зависимости от одного из торговых сегментов), и риск концентрации на одном или нескольких клиентах/контрагентах (вероятность возникновения потерь вследствие слишком большой зависимости от одного или нескольких клиентов/контрагентов).

Кредитный риск

При осуществлении СПВБ деятельности организатора торговли и клиринговой деятельности кредитных рисков СПВБ не возникает, так как СПВБ не выполняет функций центрального контрагента и не принимает на себя обязательств, связанных с исполнением сделок, заключенных на СПВБ.

Кредитный риск СПВБ может возникнуть при размещении временно свободных средств СПВБ в банковские депозиты и другие финансовые инструменты.

Требования к инвестиционной деятельности СПВБ определяются Советом директоров СПВБ. Внутренние процедуры принятия решений СПВБ при

размещении временно свободных средств в депозиты в коммерческих банках определяются Советом директоров СПВБ. Совет директоров СПВБ устанавливает лимиты на размещение временно свободных денежных средств СПВБ в коммерческие банки с учетом рекомендаций Комитета по рискам.

Инвестиционная деятельность СПВБ регулируется Положением об инвестиционных критериях размещения временно свободных средств СПВБ, которое утверждено Советом директоров СПВБ.

Системный риск

Системный риск в деятельности СПВБ как клиринговой организации отсутствует, так как в соответствии с Правилами клиринга у СПВБ не возникают расходы (убытки) в случае возникновения ситуации, когда неспособность выполнить свои обязательства одного или нескольких участников финансового рынка вызывает неспособность выполнить свои обязательства надлежащим образом других участников финансового рынка.

Рыночный риск

Рыночный риск, связанный с неблагоприятным изменением рыночной стоимости финансовых инструментов или иных активов, предоставленных СПВБ участниками клиринга в качестве обеспечения исполнения обязательств, отсутствует, так как СПВБ не выполняет функций центрального контрагента и в соответствии с Правилами клиринга не несет ответственности за исполнение обязательств перед участниками клиринга.

Рыночный риск, связанный с неблагоприятным изменением рыночной стоимости финансовых инструментов или иных активов, в которые инвестированы собственные средства СПВБ, управляется путем установления системы соответствующих лимитов на каждый вид актива и способа контроля за соблюдением принятой системы лимитов.

Состав и структура активов, в которые могут быть инвестированы собственные средства СПВБ, определяются Советом директоров СПВБ.

Правовой риск

В целях управления правовым риском СПВБ осуществляет постоянный мониторинг судебной практики, связанной с оказанием услуг в области организации торговли и клиринговой деятельности, и осуществляет анализ возможных правовых рисков.

При необходимости проводятся консультации с Банком России по неоднозначно толкуемым нормам права, связанными с оказанием услуг в области организации торговли и клиринговой деятельности.

Риск ликвидности

В качестве источников риска ликвидности СПВБ рассматривает системный риск (риск возникновения неплатежеспособности СПВБ из-за проблем в банковской системе в целом), индивидуальный риск (риск потери доступа к кредитным ресурсам из-за изменения мнения участников рынка о платежеспособности СПВБ) и технический риск (риск возникновения неплатежеспособности СПВБ из-за несбалансированной структуры платежей).

С целью снижения влияния системного риска ликвидности на деятельность СПВБ используется диверсификация вложений, использование рейтингов и лимитирование.

Для снижения индивидуального риска ликвидности поддерживается информационный обмен с банками о финансовом состоянии СПВБ.

Для оценки и управления техническим риском ликвидности осуществляется комплекс мероприятий, включающий исторический анализ структуры платежей, анализ будущих платежей на основе имеющихся обязательств и заключенным контрактам, анализ и прогнозирование возможных будущих платежей, оценка возможностей по привлечению средств при реализации разных сценариев.

Кастодиальный риск

В целях снижения кастодиального риска СПВБ заключает договоры только с депозитариями, имеющими лицензию профессионального участника рынка ценных бумаг на осуществление депозитарной деятельности, выданную в соответствии с законодательством Российской Федерации, соблюдающими требования, установленные Банком России, в том числе к размеру собственных средств и иным нормативам, установленным Банком России, и соблюдающими требования Банка России к ведению внутреннего учета и внутреннего контроля депозитарной деятельности. Также такой депозитарий должен удовлетворять хотя бы одному из следующих критериев:

- являться центральным депозитарием в соответствии с законодательством Российской Федерации;
- являться расчетным депозитарием в соответствии с законодательством Российской Федерации.

Коммерческий риск

В целях повышения эффективности финансово-хозяйственной деятельности и ликвидности СПВБ путем финансового планирования, управления и контроля исполнения бюджетов создан Бюджетный комитет СПВБ, который является действующим на постоянной основе совещательным органом, подчиняющимся Совету директоров СПВБ.

В компетенцию Бюджетного комитета входят, в том числе, следующие вопросы:

- выработка рекомендаций по определению направлений и основных принципов финансовой и бюджетной политики, политики по управлению финансовыми рисками СПВБ;
- подготовка рекомендаций по утверждению проектов квартальных и годовых бюджетов СПВБ;
- рассмотрение отчетов об исполнении бюджета СПВБ, анализ исполнения принятых квартальных и годовых бюджетов;
- рассмотрение бюджетов, бизнес-планов, сметы доходов и расходов, сметы расходов фонда потребления, сметы капитальных вложений, а также изменений к ним, подлежащим утверждению Советом директоров;
- анализ процесса бюджетирования и финансовой структуры СПВБ, выработка рекомендаций по их совершенствованию.

Риски, связанные с совмещением клиринговой деятельности и деятельности по организации торговли

СПВБ совмещает клиринговую деятельность и деятельность по организации торговли. В связи с этим СПВБ управляет как рисками, связанными с клиринговой деятельностью, так и рисками, связанными с деятельностью по организации торговли. СПВБ предпринимает меры по предотвращению и урегулированию конфликта интересов, возникающего при совмещении клиринговой деятельности и деятельности по организации торговли.

В целях снижения рисков, связанных с совмещением СПВБ клиринговой деятельности с деятельностью по организации торговли, на СПВБ созданы отдельные структурные подразделения для осуществления каждого из видов деятельности:

- клиринговый отдел, к исключительным функциям которого относится осуществление клиринговой деятельности;
- отдел организации торговли, осуществляющий деятельность по проведению организованных торгов.

Для осуществления внутреннего контроля за соответствием деятельности СПВБ, осуществляющей деятельность по организации торговли и клиринговую деятельность, требованиям законодательства Российской Федерации, нормативных актов Банка России, иных нормативных правовых актов Российской Федерации, а также правил и иных внутренних документов СПВБ назначен контролер.

Для организации и осуществления внутреннего аудита СПВБ назначен руководитель службы внутреннего аудита.

Должностные обязанности сотрудников СПВБ распределены таким образом, чтобы исключить конфликт интересов, условия его возникновения, совершение преступлений и иных противоправных действий, возможность сокрытия противоправных действий.

Для разграничения прав доступа при вводе и обработке данных реализовано организационно-техническое разделение доступа сотрудников структурных подразделений СПВБ к информационным ресурсам СПВБ с учетом функций, определенных положениями о соответствующих структурных подразделениях и должностными инструкциями сотрудников СПВБ.

Меры, направленные на предотвращение и урегулирование конфликта интересов при осуществлении клиринга и совмещении клиринговой деятельности с деятельностью по организации торговли, определены в Перечне мер, направленных на предотвращение и урегулирование конфликта интересов при проведении организованных торгов и осуществлении клиринговой деятельности.

8. КРУПНЫЕ СДЕЛКИ И СДЕЛКИ, В СОВЕРШЕНИИ КОТОРЫХ ИМЕЛАСЬ ЗАИНТЕРЕСОВАННОСТЬ

Крупные сделки

В 2020 году сделки, признаваемые в соответствии с Федеральным законом от 26 декабря 1995 года № 208-ФЗ "Об акционерных обществах" крупными сделками, не совершались.

Сделки с заинтересованностью

В 2020 году сделки, признаваемые в соответствии с Федеральным законом от 26 декабря 1995 года № 208-ФЗ "Об акционерных обществах" сделками, в совершении которых имелась заинтересованность, не совершались.

9. КОРПОРАТИВНОЕ УПРАВЛЕНИЕ

Корпоративное управление представляет собой систему взаимоотношений между руководством СПВБ, Советом директоров, акционерами и другими заинтересованными сторонами. Последовательное развитие системы корпоративного управления направлено прежде всего на повышение эффективности и конкурентоспособности СПВБ, а также на то, чтобы обеспечивать постоянное позитивное восприятие системы корпоративного управления со стороны акционеров, инвесторов и представителей бизнес-сообщества.

Структура корпоративного управления СПВБ, в соответствии с действующими корпоративными документами, включает в себя:

- Общее собрание акционеров, которое является высшим органом управления СПВБ, принимающим решения по основным вопросам хозяйственной деятельности;
- Совет директоров, который осуществляет общее руководство деятельностью СПВБ, за исключением вопросов, отнесенных Уставом СПВБ к компетенции Общего собрания акционеров;
- Комитеты при Совете директоров, сформированные для предварительного рассмотрения и проработки наиболее важных вопросов деятельности СПВБ и подготовки рекомендаций Совету директоров для принятия решений в функциональных областях в соответствии со своей компетенцией;
- Корпоративного секретаря, который обеспечивает взаимодействие с акционерами, координацию действий СПВБ по защите прав и интересов акционеров, поддержку работы Совета директоров, Правления;
- Ревизионную комиссию, которая осуществляет контроль за финансово-хозяйственной деятельностью СПВБ, проводит тематические проверки, дает оценку достоверности данных, включаемых в Годовой отчет и содержащихся в годовой бухгалтерской отчетности СПВБ, подготовленной по российским стандартам.

Общее собрание акционеров

Общее собрание акционеров является высшим органом управления СПВБ. Акционеры СПВБ обладают совокупностью прав, реализация которых осуществляется ими лично или через представителей путем участия в работе Общего собрания акционеров с правом голоса по всем вопросам, отнесенным к его компетенции. Перечень вопросов, относящихся к компетенции Общего собрания акционеров, определен Федеральным законом от 26 декабря 1995 года № 208-ФЗ «Об акционерных обществах» и Уставом СПВБ.

Годовое общее собрание акционеров СПВБ по итогам работы за 2019 год состоялось 24 августа 2020 года. В собрании приняли участие акционеры или представители акционеров, владеющие в общей сложности 100% акционерного капитала СПВБ, что соответствует требованиям кворума. В ходе годового общего собрания акционеров приняты решения по обязательным вопросам, предусмотренным пунктом 1 статьи 47 Федерального закона «Об акционерных обществах», а также по вопросу о распределении прибыли СПВБ по итогам 2020 года, в том числе о выплате дивидендов.

Совет директоров

Совет директоров, являясь ключевым звеном системы корпоративного управления, осуществляет стратегическое управление СПВБ, определяет основные принципы и подходы к организации системы управления рисками и внутреннего аудита, контролирует деятельность исполнительных органов, а также реализует иные функции. Совет директоров подотчетен Общему собранию акционеров и избирается решением Общего собрания акционеров.

Компетенция Совета директоров определена в Уставе и четко разграничена с компетенцией исполнительных органов СПВБ, осуществляющих руководство ее текущей деятельностью.

В частности, Совет директоров:

- определяет миссию, стратегию;
- отвечает за стратегическое управление и долгосрочное устойчивое развитие;
- устанавливает стратегические цели и ключевые показатели эффективности деятельности.

При разработке стратегии СПВБ Совет директоров учитывает мнение акционеров по вопросу развития СПВБ.

Утвержденная Советом директоров Концепция стратегии развития СПВБ на период 2021-2025 годы включает в себя основные вопросы деятельности, рассмотрение которых соотносено с циклом стратегического планирования и существующими бизнес-циклами СПВБ. При подготовке плана работы учитываются предложения членов Совета директоров и менеджмента по определению приоритетных направлений деятельности.

Члены Совета директоров обладают опытом и профессиональными компетенциями, необходимыми для реализации стратегии СПВБ.

В соответствии с Уставом количественный состав Совета директоров определяется решением Общего собрания акционеров. В настоящее время Совет директоров состоит из 6 человек.

Руководство Советом директоров и организация его деятельности осуществляются председателем Совета директоров.

В целях предварительного рассмотрения и подготовки рекомендаций для принятия Советом директоров решений по наиболее важным вопросам при Совете директоров сформированы следующие комитеты:

- Комитет по рискам и аудиту;
- Технический комитет;
- Бюджетный комитет.

Информация о наличии у членов Совета директоров и членов Правления конфликта интересов (в том числе связанного с участием указанных лиц в органах управления СПВБ) отсутствует.

За период с 1 января по 31 декабря 2020 года было проведено 16 заседаний Совета директоров.

Многие вопросы повестки дня заседаний Совета директоров предварительно рассматриваются Правлением и соответствующими комитетами для предварительной проработки вопросов и подготовки рекомендаций Совету директоров.

Среди вопросов, связанных с реализацией Советом директоров своих основных функций, в 2020 году Советом директоров были рассмотрены:

стратегические вопросы:

- утверждена Концепция стратегии развития СПВБ на период 2021-2025 годы;
- разработана программа по повышению качества управления закупочной деятельностью и внесению изменений во внутренние нормативные документы, регламентирующие закупочную деятельность.

кадровые вопросы:

- сформированы рекомендации акционерам по персональному составу Совета директоров СПВБ для избрания на годовом Общем собрании акционеров;
- приняты решения о количественном и персональном составе Правления и комитетов при Совете директоров СПВБ.

вопросы, связанные с развитием бизнеса:

- Правила листинга, Правила клиринга, Правила организованных торгов, Правила допуска к торгам;
- Положение о Биржевом совете, Положения о Советах секций, Положения осекциях;
- изменение состава Участников торгов биржевых секций.

Комитет по рискам и аудиту

Основной целью деятельности Комитета по рискам и аудиту является обеспечение эффективной работы Совета директоров СПВБ в решении вопросов, относящихся к контролю за финансово-хозяйственной деятельностью и принимаемыми в процессе неё рисками.

В 2020 году проведено 18 заседаний, на которых рассмотрено 27 вопросов.

Основные вопросы, которые Комитет рассматривал в 2020 году и по которым представлял соответствующие рекомендации Совету директоров, были связаны с оценкой и выбором кандидатов в аудиторы, рассмотрение отчета внешнего аудитора СПВБ и ежеквартальных отчетов о рисках СПВБ.

Комитет по рискам и аудиту рассмотрел вопросы об определении инвестиционных критериев размещения и о регламенте размещения временно свободных денежных средств СПВБ, а также рассмотрел перечень лимитов на банки при размещении временно свободных денежных средств СПВБ на 2020 год.

В июле 2020 года Комитет по рискам и аудиту одобрил новую редакцию Методики самооценки процесса обеспечения готовности к инцидентам и непрерывности деятельности СПВБ.

Технический комитет

Основной целью деятельности Технического комитета является контроль за обновлением и усовершенствованием технического обеспечения деятельности СПВБ.

В 2020 году проведено 16 заседаний, на которых рассмотрено 36 вопросов.

Основные вопросы, которые Технический комитет рассматривал в 2020 году, были связаны с обеспечением размещения ОФЗ и ОБР на ИТ-платформе СПВБ и разработки стратегии развития ИТ-платформы СПВБ.

В феврале 2020 г. Технический комитет рассмотрел вопрос о техническом задании на внедрение программного продукта на базе технологической платформы «1С Предприятие 8.3» для составления и предоставления в Банк России надзорной и бухгалтерской отчетности СПВБ в формате XBRL.

Технический комитет рассмотрел вопросы о сметной стоимости серверов и рабочих станций для обеспечения требования информационной безопасности, а также о сметной стоимости средств серверного оборудования для Торгово-Клиринговой системы (ТКС), и подготовил соответствующие рекомендации для Правления СПВБ.

Бюджетный комитет

Основной целью деятельности Бюджетного комитета является повышение эффективности финансово-хозяйственной деятельности и ликвидности СПВБ путем финансового планирования, управления и контроля исполнения бюджетов, подготовка соответствующих рекомендаций Совету директоров в части бюджетного управления, а также осуществление контроля за исполнением бюджета и решений Совета директоров.

В 2020 году проведено 2 заседания, на которых рассмотрено 4 вопроса.

Основные вопросы, которые Комитет рассматривал в 2020 году и по которым представлял соответствующие рекомендации Совету директоров, были связаны с планированием и контролем за исполнением бюджета СПВБ.

Корпоративный секретарь

Связующим звеном системы корпоративного управления является Корпоративный секретарь, который обеспечивает эффективное текущее взаимодействие с акционерами, координацию действий СПВБ по защите прав и

интересов акционеров и поддержку эффективной работы Совета директоров и его комитетов.

Помимо сопровождения деятельности Совета директоров, Корпоративный секретарь СПВБ осуществляет сопровождение деятельности Правления. Объединение данных функций позволяет повысить эффективность взаимодействия менеджмента и Совета директоров СПВБ.

Сопровождение Корпоративным секретарем СПВБ всех корпоративных процедур позволяет выстраивать динамичную и сбалансированную систему корпоративного управления, обеспечивать эффективное взаимодействие между акционерами, Советом директоров и менеджментом СПВБ.

В соответствии с решением Совета директоров функцию корпоративного секретаря СПВБ осуществляет руководитель Управления делами СПВБ, административно подчиняющийся Управляющему, а функционально подчиняющийся Председателю Совета директоров.

При этом решения о назначении на должность, увольнении с должности принимает Совет директоров, что дает необходимую степень самостоятельности в рамках организации работы органов управления.

Ревизионная комиссия

Ревизионная комиссия является постоянно действующим органом контроля финансово-хозяйственной деятельности СПВБ. Ревизионная комиссия действует в интересах акционеров и в своей деятельности подотчетна Общему собранию акционеров.

Ревизионная комиссия на основании Устава и Положения о Ревизионной комиссии проводит проверки финансово-хозяйственной деятельности СПВБ, по итогам которых формирует заключение. Выводы Ревизионной комиссии доводятся до сведения акционеров на годовом Общем собрании акционеров.

В соответствии с законодательством Российской Федерации Ревизионная комиссия осуществляет контроль за финансово-хозяйственной деятельностью СПВБ, проводит тематические проверки, дает оценку достоверности данных, включаемых в Годовой отчет и содержащихся в Годовой бухгалтерской отчетности СПВБ, подготовленной по российским стандартам.

Годовым Общим собранием акционеров избирается Ревизионная комиссия в количестве трех человек.

10. ПЕРСПЕКТИВЫ РАЗВИТИЯ СПВБ

В соответствии с утвержденной в 2020 году Концепцией стратегии развития на период 2021 - 2025 годы к 2025 году СПВБ планирует стать универсальной высокотехнологичной финансовой компанией. Для достижения поставленных целей СПВБ:

- продолжит расширение линейки финансовых инструментов и сервисов,
- усовершенствует условия по проведению организованных торгов и повысит доступность продуктов и услуг для участников,
- приступит к созданию надежной, производительной высокотехнологичной платформы.

С учетом современных тенденций развития рынков финансовых услуг, ситуации на финансовом рынке РФ, а также сильных сторон СПВБ и дочерних организаций, входящих в Группу СПВБ, планируется сосредоточить усилия и ресурсы на реализации следующих основных проектов:

1. Модернизация технологической платформы Группы СПВБ в целях создания прогрессивной информационной эко-системы, объединяющей в своем составе централизованный торгово-клиринговый комплекс, инвестиционную платформу, сервисы на основе технологий распределенных реестров (блокчейн-сеть), расчетный банк, расчетный депозитарий и удобные интерфейсы коммуникации, в том числе на уровне обеспечения прямого доступа для конечных пользователей.
2. Расширение продуктовой линейки денежного рынка в диапазоне от целевых корпоративных продуктов до продуктов на основе коллективного инвестирования.
3. Развитие линейки финансовых инструментов нового «гибридного» типа на основе законодательства и технологий выпуска, обращения и погашения цифровых прав и цифровых финансовых активов.
4. Развитие проекта расчетного банка.
5. Развитие продуктовой линейки фондового рынка в части долговых ценных бумаг.
6. Развитие клиринговых услуг по сделкам на организованном товарном рынке.

В 2021 году СПВБ намерена усилить свои позиции на рынке кредитных ресурсов и услуг по проведению денежных аукционов и клиринга, сделок частных и государственных компаний, органов государственной власти и управления за счет активного продвижения своих сервисов среди новых категорий клиентов, таких как субъекты Российской Федерации и компании с их участием, а также крупные корпоративные клиенты. Обновление технологической платформы НКО АО ПРЦ, выполняющей функции расчетного центра для рынков СПВБ, позволит повысить скорость и качество обслуживания участников торгов, предложить им дополнительные сервисы по размещению денежных средств, а также выйти на рынок оказания расчетных услуг.

На фондовом рынке СПВБ планирует сосредоточиться на сегменте долговых ценных бумаг. В частности, в 2021 году планируется завершение проекта по подготовке к проведению операций по размещению, а в дальнейшем и обращению облигаций федерального займа и облигаций Банка России, запустить механизм первичного размещения долгосрочных корпоративных облигаций.

В рамках проводимой работы по развитию биржевых инструментов СПВБ планирует продолжать активное сотрудничество с НКО АО НРД и Банком России.

В 2021 году продолжится работа по разработке новых финансовых инструментов. Особое внимание планируется уделить проектам создания финансовых инструментов нового типа с использованием цифровых подходов. Продукты на основе утилитарных цифровых прав и цифровых финансовых активов позволят предложить рынку принципиально новые возможности организации финансовой деятельности. Одним из направлений этой работы является создание в рамках Группы СПВБ инвестиционной интернет-платформы.

В целях реализации поставленных задач СПВБ планирует модернизировать свой программно-технический комплекс, дополнить его новыми функциональными модулями в соответствии с современными стандартами и требованиями надежности и производительности, а также с учетом номенклатуры торгуемых инструментов.

Реализация намеченных мероприятий существенно улучшит условия по проведению организованных торгов, клиринговой деятельности, снизит издержки участников торгов, что будет способствовать улучшению конкурентных позиций СПВБ и росту финансовых результатов от биржевой деятельности.

Управляющий СПВБ



С.А. Жаров



11. СВЕДЕНИЯ О СОСТАВЕ СОВЕТА ДИРЕКТОРОВ СПББ

Сведения приведены по состоянию с 01 января 2020 г. по 31 декабря 2020 г.

Информация не подлежит раскрытию на основании:

1. части 3.1 статьи 19 Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» и установленного перечня информации, который клиринговая организация вправе не раскрывать и (или) раскрывать в ограниченном объеме, определенном постановлением Правительства Российской Федерации от 17 июля 2019 г. № 912;

2. части 3.1 статьи 22 Федерального закона «Об организованных торгах» и установленного перечня информации, который, организатор торговли вправе не раскрывать и (или) раскрывать в ограниченном объеме, определенном постановлением Правительства Российской Федерации от 17 июля 2019 г. № 913.

12. СВЕДЕНИЯ ОБ УПРАВЛЯЮЩЕМ

Сведения приведены по состоянию с 01 января 2020 г. по 31 декабря 2020 г.

Информация не подлежит раскрытию на основании:

1. части 3.1 статьи 19 Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» и установленного перечня информации, который клиринговая организация вправе не раскрывать и (или) раскрывать в ограниченном объеме, определенном постановлением Правительства Российской Федерации от 17 июля 2019 г. № 912;

2. части 3.1 статьи 22 Федерального закона «Об организованных торгах» и установленного перечня информации, который, организатор торговли вправе не раскрывать и (или) раскрывать в ограниченном объеме, определенном постановлением Правительства Российской Федерации от 17 июля 2019 г. № 913.

13. СВЕДЕНИЯ О СОСТАВЕ ПРАВЛЕНИЯ СПВБ

Сведения приведены по состоянию с 01 января 2020 г. по 31 декабря 2020 г.

Информация не подлежит раскрытию на основании:

1. части 3.1 статьи 19 Федерального закона «О клиринге, клиринговой деятельности и центральном контрагенте» и установленного перечня информации, который клиринговая организация вправе не раскрывать и (или) раскрывать в ограниченном объеме, определенном постановлением Правительства Российской Федерации от 17 июля 2019 г. № 912;
2. части 3.1 статьи 22 Федерального закона «Об организованных торгах» и установленного перечня информации, который, организатор торговли вправе не раскрывать и (или) раскрывать в ограниченном объеме, определенном постановлением Правительства Российской Федерации от 17 июля 2019 г. № 913.

14. КРИТЕРИИ ОПРЕДЕЛЕНИЯ И РАЗМЕР ВОЗНАГРАЖДЕНИЯ ЧЛЕНОВ СОВЕТА ДИРЕКТОРОВ СПВБ И ЧЛЕНОВ ПРАВЛЕНИЯ СПВБ

Размер вознаграждения членов Совета директоров СПВБ устанавливается решением Годового Общего собрания акционеров по итогам финансовой деятельности за отчетный год.

Решением Годового Общего собрания акционеров СПВБ от 24 августа 2020 года размер вознаграждения членам Совета директоров СПВБ по итогам 2019 финансового года не утвержден.

Размер всех видов вознаграждения, включая заработную плату, которые были выплачены членам Правления СПВБ в течение 2020 года, составил 28 949 тыс. руб. (в течение 2019 года – 33 719 тыс. руб.)

15. Приложение 1

ГODOВАЯ БУХГАЛТЕРСКАЯ (ФИНАНСОВАЯ) ОТЧЕТНОСТЬ СПВБ ЗА ПЕРИОД С 1 ЯНВАРЯ ПО 31 ДЕКАБРЯ 2020 ГОДА

16. Приложение 2

**АУДИТОРСКОЕ ЗАКЛЮЧЕНИЕ О ГОДОВОЙ БУХГАЛТЕРСКОЙ (ФИНАНСОВОЙ)
ОТЧЕТНОСТИ СПВБ ЗА ПЕРИОД С 1 ЯНВАРЯ ПО 31 ДЕКАБРЯ 2020 ГОДА**

17. Приложение 3

**КОНСОЛИДИРОВАННАЯ ФИНАНСОВАЯ ОТЧЕТНОСТЬ СПВБ ЗА ГОД,
ЗАКОНЧИВШИЙСЯ 31 ДЕКАБРЯ 2020 ГОДА**

18. Приложение 4

АУДИТОРСКОЕ ЗАКЛЮЧЕНИЕ О ГОДОВОЙ КОНСОЛИДИРОВАННОЙ ФИНАНСОВОЙ ОТЧЕТНОСТИ СПВБ ЗА 2020 ГОД