

«УТВЕРЖДЕН»

Решением Совета директоров
АО НПФ «Владимир»

Протокол заседания Совета директоров Фонда
№ 36 от 22 августа 2017 года



Председатель Совета директоров Фонда

А.В. Гончаров

ПОРЯДОК

**определения объема средств пенсионных накоплений,
пенсионных резервов передаваемых в доверительное
управление управляющей компании**

Акционерного общества

негосударственный пенсионный фонд «Владимир»

МОСКВА

2017 г.

Настоящий Порядок определения объема средств пенсионных накоплений, пенсионных резервов передаваемых в доверительное управление управляющей компании (далее – Порядок) Акционерного общества негосударственный пенсионный фонд «Владимир» (далее – Фонд) определяет порядок оценки надежности управляющей компании и расчета предельного объема средств пенсионных накоплений (далее – ПН) и/или пенсионных резервов (далее – ПР) передаваемых Фондом в доверительное управление управляющей компании в соответствии с требованиями Указания Банка России № 4060-У от 04.07.2016 «О требованиях к организации системы управления рисками негосударственного пенсионного фонда».

Оценка деятельности управляющей компании (далее – УК) осуществляется Отделом управления рисками Фонда по десяти критериям надежности, разделенным на три группы: устойчивость, качество управления активами и открытость – в соответствии с Таблицей №1.

УК по каждому из десяти критериев оценки ее деятельности получает балльную оценку: от нуля (минимальный балл) до двух (максимальный).

Итоговое количество баллов формируется в результате взвешенного суммирования баллов, набранных УК. В зависимости от полученной балльной оценки определяется предельный объем средств ПН и/или ПР, передаваемых в доверительное управление УК в соответствии с Таблицей №2.

Весовые коэффициенты и уровни надежности определены на основе экспертной оценки с учетом опыта работы Фонда на финансовом рынке

Таблица №1

Группа критериев	Критерий	Балл	Вес
Устойчивость	Размер средств в доверительном управлении		
	Объем средств под управлением более 5 млрд. руб.	2	2
	Объем средств под управлением от 1 до 5 млрд. руб.	1	
	Объем средств под управлением до 1 млрд. руб.	0	
	Размер собственного капитала		
	Объем собственных средств более 100 млн. руб.	2	2
	Объем собственных средств от 50 до 100 млн. руб.	1	
	Объем собственных средств до 50 млн. руб.	0	
	Опыт работы управляющей компании на рынке услуг доверительного управления		
	Срок работы на рынке доверительного управления (от момента начала работы УК - привлечения первого	2	2

клиента или формирования фонда) превышает 5 лет		
Срок работы на рынке доверительного управления составляет от 3 до 5 лет	1	
Срок работы на рынке доверительного управления составляет менее 3 лет	0	
Система управления рисками в организационной структуре		
В организационной структуре УК присутствует штатная единица или подразделение риск-менеджмента и полностью сформирована нормативная база системы управления рисками в соответствии с требованиями «Порядка взаимодействия Фонда и управляющих компаний по ограничению рисков»	2	1
В организационной структуре УК присутствует штатная единица или подразделения риск-менеджмента, но не полностью сформирована нормативная база в соответствии с требованиями «Порядка взаимодействия Фонда и управляющих компаний по ограничению рисков»	1	
В организационной структуре УК отсутствует штатная единица или подразделение риск-менеджмента	0	
Соответствие квалификационным требованиям сотрудников УК		
Сотрудники УК, перечисленные в Приказе ФСФР №10-4/пз-н от 28.01.2010г., имеют квалификационный аттестат серии 5.0	2	1
У сотрудников, перечисленных в Приказе ФСФР №10-4/пз-н от 28.01.2010г., отсутствует квалификационный аттестат серии 5.0, но УК предоставлен план по получению сотрудниками квалификационных аттестатов серии 5.0	1	
У сотрудников, перечисленных в Приказе ФСФР №10-4/пз-н от 28.01.2010г., отсутствует квалификационный аттестат серии 5.0, или не был исполнен предоставленный ранее УК план по получению сотрудниками квалификационных аттестатов серии 5.0	0	

Качество управления активами	Наличие/отсутствие убытков у УК на протяжении деятельности		
	Отсутствие убытков в течение предшествующих пяти лет	2	1
	Отсутствие убытков в периоде двух лет, предшествующих году проведения оценки	1	
	Убытки в периоде двух лет, предшествующих году проведения оценки	0	
	Накопленная доходность управления средствами ПИ за 3 года		
	УК занимает место не ниже 15-го согласно рейтингу сайта prf.investfunds.ru по доходности управления средствами ПИ за 3 предшествующих года	2	2
	УК занимает место не ниже 25-го согласно рейтингу сайта prf.investfunds.ru по доходности управления средствами ПИ за 3 предшествующих года	1	
	УК занимает место ниже 25-го согласно рейтингу сайта prf.investfunds.ru по доходности управления средствами ПИ за 3 предшествующих года	0	
	Динамика изменения доли компании на рынке ДУ средствами НПФ		
	Доля УК (по показателю объема средств НПФ в ДУ) в общем объеме средств, стабильно увеличивалась (не менее трех лет)	2	1
Доля УК на рынке изменяется на протяжении трех лет без единой динамики	1		
Доля УК на рынке снижается на протяжении трех лет	0		
Открытость	Структура собственников УК		
	УК предоставила полную информацию о структуре своего владения до конечного бенефициара – физического лица	2	1
	УК предоставила структуру собственности, но не предоставила данных о конечных бенефициарах	1	
	Отсутствует информация о собственниках УК	0	

Информационная прозрачность		
УК имеет свой сайт в сети «Интернет», на котором в полной мере раскрывается вся, определенная нормативными актами, необходимая информация, а так же предоставляется в Фонд вся информация, требуемая для оценки УК согласно настоящему Порядку	2	1
У Фонда возникли подозрения в недостоверности предоставленной информации или неполного предоставления информации, требуемой для оценки УК согласно настоящему Порядку	1	
УК не публикует в открытых источниках информацию, определенную нормативными актами и / или отказывает в предоставлении информации для оценки ее деятельности по настоящему Порядку	0	

Данный метод оценки УК учитывает основные факторы, способные повлиять на устойчивость и надежность УК. Для более объективной оценки УК в методологию анализа вводится система бонусов и штрафов, которые учитывают специфические факторы характерные для каждой отдельно взятой УК.

В зависимости от степени влияния дополнительно выявленных факторов надежности, не рассматриваемых в настоящем Порядке, УК присваиваются баллы от (-2) до (+2). Удельный вес одного штрафного (бонусного) балла (k) принимается равным «1».

Общее значение уровня надежности УК производится по следующей формуле:

$$P = \sum(\text{балл} * \text{вес}) + k, \text{ где}$$

P – количественная оценка уровня надежности;

балл – полученный УК балл по каждому из рассматриваемых критериев;

вес – весовой коэффициент, соответствующий каждому из рассматриваемых критериев;

k – дополнительно выявленный фактор.

Итоговый объем средств ПН и/или ПР передаваемых в доверительное управление УК определяется решением Генерального директора Фонда.

Определение объема средств ПН и ПР, передаваемых в ДУ	
Доля Р, от максимально возможного количества взвешенных баллов ¹	Объем передаваемых средств ПН и/или ПР в ДУ
Не менее 75%	До 100%
от 50% до 75%	До 50%
от 25% до 50%	До 10%
Не более 25%	0%

¹ При применении дополнительно выявленного фактора (k) при оценке УК, согласно настоящему Порядку, максимально возможное количество взвешенных баллов составит – 30, если дополнительно выявленный фактор (k) не применяется, то максимально возможное количество взвешенных баллов составит – 28

Пропито, пронумеровано и скреплено печатью на 6 листах
Председатель Совета директоров АО НПФ «Владимир»

А.В. Гончаров

