



Методика формирования рейтингов торговцев ценными бумагами - операторов рынка ОВГЗ

Редакция от 23.11.2011

1.1. Рейтинги торговцев ценными бумагами - операторов рынка облигаций внутреннего государственного займа (далее - рейтинги) рассчитываются с целью повышения информационной прозрачности деятельности компаний-торговцев ценными бумагами путем подготовки и обнародования статистической информации о состоянии развития рынка государственных ценных бумаг. Мнение Разработчика рейтинга может не совпадать с позицией организаций, включаемых в рейтинг.

1.2. Рейтинги разрабатываются ООО «Сбондс-Украина» (далее Разработчик) в соответствии с этой методикой на основе данных полученных от саморегулируемой организации Ассоциация «Украинские фондовые торговцы» (далее - СРО АУФТ). При возникновении ситуаций, не урегулированных этой методикой, Разработчик оставляет за собой право на решение этих ситуаций в соответствии с целью составления рейтингов, указанной в пункте 1.1

1.3. В расчет рейтингов включаются итоговые данные, предоставленные СРО АУФТ, рассчитанные в соответствии с «Методикой формирования рейтингов торговцев ценными бумагами - операторов рынка ОВГЗ», утвержденной Решением Совета СРО АУФТ (Протокол № 19 от 06.09.2011).

1.4. Рейтинги составляются по итогам 1, 2, 3, 4 кварталов и года.

1.5. Рейтинги составляются по следующим сегментам рынка ОВГЗ:

1.5.1. Рейтинг по общему объему заключенных и выполненных договоров по ОВГЗ на биржевом и внебиржевом рынке.

1.5.2. Рейтинг по объему заключенных и выполненных договоров по ОВГЗ на биржевом рынке.

1.5.3. Рейтинг по объему заключенных и выполненных договоров по ОВГЗ на внебиржевом рынке.

1.5.4. Рейтинг по общему количеству заключенных и выполненных договоров по ОВГЗ на биржевом и внебиржевом рынке.

1.5.5. Рейтинг по количеству заключенных и выполненных договоров по ОВГЗ на биржевом рынке.

1.5.6. Рейтинг по количеству заключенных и выполненных договоров по ОВГЗ на внебиржевом рынке.

1.6. В соответствии с «Методикой формирования рейтингов торговцев ценными бумагами - операторов рынка ОВГЗ», утвержденной Решением Совета СРО АУФТ при расчете итоговых

данных для рэнкингов, указанных в п.п. 1.5.1-1.5.3, включается следующий показатель - доля рынка торговца ценными бумагами - члена СРО АУФТ в разрезе сегментов рынка ОВГЗ, рассчитанная как отношение суммы договоров, заключенных с участием торговца ценными бумагами, к общему объему договоров по ОВГЗ, заключенных и выполненных членами СРО АУФТ, предоставивших отчетность в АУФТ по следующей формуле:

$$R_i = \frac{S_i^b + S_i^a}{\sum_{i=1}^m (S_i^b + S_i^a)},$$

где

i - торговец ценными бумагами, согласно предоставленных в СРО АУФТ квартальных административных данных заключал и выполнял в течение отчетного квартала договоры по ОВГЗ;

R_i - доля рынка i -го торговца ценными бумагами в разрезе сегментов рынка ОВГЗ;
 m - количество торговцев ценными бумагами, которые согласно предоставленных в СРО АУФТ квартальных административных данных заключали и выполняли в течение отчетного квартала договоры по ОВГЗ;

S_i^b, S_i^a - совокупные суммы всех договоров (дилерских договоров купли-продажи, договоров на выполнение комиссионных договоров, договоров поручения, договоров на брокерское обслуживание, договоров об управлении) с ОВГЗ, заключенных и выполненных на определенном сегменте рынка ОВГЗ i -м торговцем ценными бумагами, где он выступает продавцом или покупателем соответственно.

1.7. В соответствии с «Методикой формирования рэнкингов торговцев ценными бумагами - операторов рынка ОВГЗ», утвержденной Решением Совета СРО АУФТ при расчете итоговых данных для рэнкингов, указанных в п.п. 1.5.4-1.5.6, включается следующий показатель - доля рынка торговца ценными бумагами - члена СРО АУФТ в разрезе сегментов рынка ОВГЗ, рассчитанная как отношение количества договоров, заключенных и выполненных при участии торговца ценными бумагами, к общему количеству договоров по ОВГЗ, заключенных и выполненных членами СРО АУФТ, предоставивших отчетность в АУФТ по следующей формуле:

$$R_i = \frac{N_i^b + N_i^a}{\sum_{i=1}^m (N_i^b + N_i^a)},$$

где

i - торговец ценными бумагами, согласно предоставленных в СРО АУФТ квартальных административных данных заключал и выполнял в течение отчетного квартала договоры по ОВГЗ;

R_i - доля рынка i -го торговца ценными бумагами в разрезе сегментов рынка ОВГЗ;
 m - количество торговцев ценными бумагами, которые согласно предоставленных в СРО АУФТ квартальных административных данных заключали и выполняли в течение отчетного квартала договоры по ОВГЗ;

N_i^b, N_i^a - количество всех договоров (дилерских договоров купли-продажи, договоров на выполнение комиссионных договоров, договоров поручения, договоров на брокерское обслуживание, договоров об управлении) с ОВГЗ, заключенных и выполненных на определенном сегменте рынка ОВГЗ i -м торговцем ценными бумагами, где он выступает продавцом или покупателем соответственно.

1.8. Разработчик гарантирует неразглашение сведений, используемых в ходе формирования рейтингов, в форме, отличной от итоговых рейтингов, в частности путем применения автоматического расчета рейтингов программными средствами и другие меры обеспечения безопасности информации, в соответствии с внутренними положениями и правилами СРО АУФТ.

1.9. Рейтинги не является показателем качества услуг и профессионализма. СРО АУФТ и ИА Cbonds не несут ответственности за некорректное использование результатов рейтингов в рекламных и маркетинговых целях.

1.10. В рейтинги по итогам 1, 2, 3, 4 кварталов включаются тридцать ведущих торговцев в каждом сегменте. В рейтинги по итогам года включаются пятьдесят ведущих торговцев в каждом сегменте.

1.11. Адреса публикации рейтингов: <http://www.cbonds.info/ua/>, <http://www.aust.com.ua>.

Контактные лица по вопросам, касающимся представленных рейтингов:

Сергей Ляшенко, Менеджер раздела Cbonds по Украине
тел/факс: +38 (044) 468-64-34, e-mail: slyasenko@cbonds.info

Константин Лысенко, Руководитель региональных проектов Cbonds
тел/факс: +7 (812) 336-97-21 (вн. 125), e-mail: lysenko@cbonds.info

Татьяна Стоян, Специалиста отдела по взаимодействию с членами СРО АУФТ
тел. +38 (056) 373-97-84, e-mail: t.stoyan@aust.com.ua

Справка

ООО «Сбондс-Украина»

ООО «Сбондс-Украина» входит в состав Информационного агентства Cbonds, специализирующегося в сфере финансовых рынков. Агентство осуществляет деятельность в России, Украине, Казахстане и Польше по следующим направлениям бизнеса: поддержание и развитие информационных сайтов (Cbonds.Info и Investfunds), проведение тематических конференций и выставок по финансовым рынкам, издательская деятельность (журнал Cbonds Review и ежегодные справочники).

СРО Ассоциация « Украинские фондовые торговцы»

СРО Ассоциация «Украинские Фондовые Торговцы» является открытым добровольным договорным объединением профессиональных участников рынка ценных бумаг, осуществляющих торговлю ценными бумагами. Своей основной задачей Ассоциация видит создание нормативных, технологических и организационных условий для привлечения на фондовый рынок Украины как можно более широкого круга инвесторов, прежде всего – физических лиц. В соответствии с Решением ГКЦБФР от 22 мая 2009 года № 483 Ассоциация "Украинские фондовые торговцы", является саморегулируемой организацией, объединяющей юридических лиц, осуществляющих профессиональную деятельность на фондовом рынке, а именно - деятельность по торговле ценными бумагами.