



Банк России

Центральный банк Российской Федерации



№ 1

2016

Информационно-
аналитические
материалы

**ОБЗОР КЛЮЧЕВЫХ
ПОКАЗАТЕЛЕЙ
ПРОФЕССИОНАЛЬНЫХ
УЧАСТНИКОВ РЫНКА
ЦЕННЫХ БУМАГ**

Москва

Настоящий Обзор подготовлен Департаментом развития финансовых рынков и Департаментом сбора и обработки отчетности некредитных финансовых организаций.

Статистические данные, использованные в Обзоре, а также методические комментарии публикуются на сайте Банка России.

Замечания, комментарии и предложения, касающиеся структуры и содержания Обзора, можно направлять по адресу: reports@cbr.ru.

При использовании материалов выпуска ссылка на Центральный банк Российской Федерации обязательна.

СОДЕРЖАНИЕ

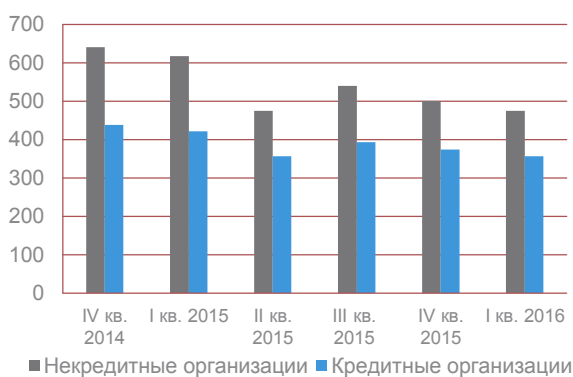
1. ПРОФЕССИОНАЛЬНЫЕ УЧАСТНИКИ РЫНКА ЦЕННЫХ БУМАГ.....	4
1.1. БРОКЕРЫ, ДИЛЕРЫ И ДОВЕРИТЕЛЬНЫЕ УПРАВЛЯЮЩИЕ.....	5
1.2. РЕГИСТРАТОРЫ.....	9
2. КЛЮЧЕВЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ ПРОФЕССИОНАЛЬНЫХ УЧАСТНИКОВ РЫНКА ЦЕННЫХ БУ- МАГ.....	10
3. МЕТОДИЧЕСКИЕ ПОЯСНЕНИЯ К КЛЮЧЕВЫМ ПОКАЗАТЕЛЯМ ПРОФЕССИОНАЛЬНЫХ УЧАСТНИКОВ РЫНКА ЦЕННЫХ БУМАГ.....	12

1. ПРОФЕССИОНАЛЬНЫЕ УЧАСТНИКИ РЫНКА

В первом квартале 2016 года продолжилось сокращение количества профессиональных участников рынка ценных бумаг - до 832 организаций на конец периода (875 на начало года). При этом количество профучастников-некредитных финансовых организаций (профучастники-НФО) за первые три месяца 2016 года снизилось на 5,2%, до 475. Количество кредитных организаций, имеющих лицензию профучастников (профучастники-КО), на конец квартала составило 357 (-4,5% к началу года).

Всего за первый квартал 2016 года было аннулировано 150 лицензий. Основными причинами отзыва лицензий стали: собственная инициатива компаний (55 лицензий), нарушения (49 лицензий), отзыв лицензии на осу-

Рисунок 1.1
Динамика количества организаций-
профессиональных участников рынка ценных
бумаг (ед.)



Источник: Банк России

ществление банковских операций (40 лицензий). По другим причинам было отозвано 6 лицензий. При этом одной из главных причин добровольного прекращения деятельности может считаться низкая рентабельность бизнеса.

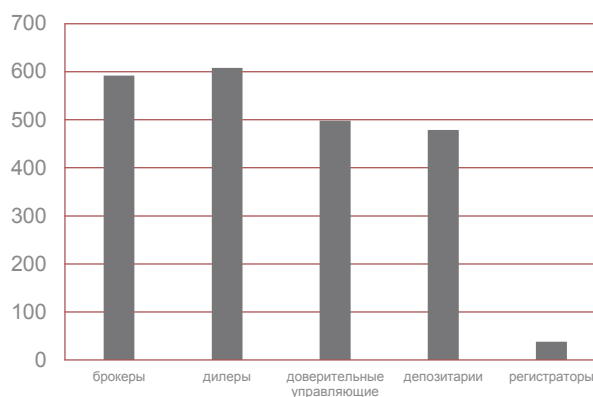
Сокращение количества участников приводит к увеличению концентрации в отрасли: ко-

личество компаний, совместно контролирующих 80% активов профучастников-НФО, сократилось до 31 организации (6,5% от общего количества компаний).

За первые три месяца 2016 года произошел ряд изменений в нормативном регулировании, регулирующем деятельность профессиональных участников рынка ценных бумаг. Так, установлен¹ порядок приостановления и возобновления Банком России действия лицензии на осуществление профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, порядок принятия Банком России решений об аннулировании лицензии и исчерпывающий перечень документов, прилагаемых лицензиатом к письменному заявлению об аннулировании лицензии профессионального участника рынка ценных

Рисунок 1.2

Количество лицензий по видам деятельности
на конец первого квартала 2016г. (ед.)



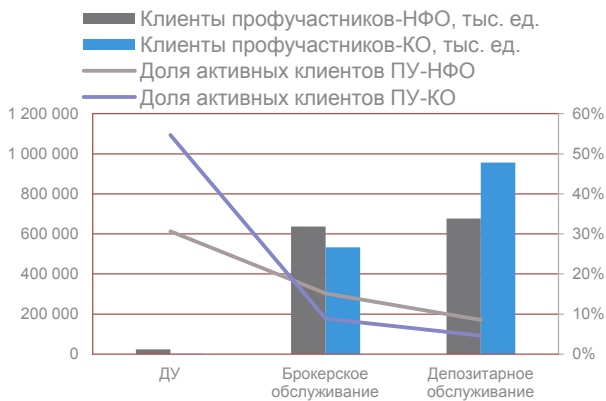
Источник: Банк России

бумаг, а также порядок их оформления. Кроме того, вступили в силу подзаконные нормативно-правовые акты, отменяющие некоторые правовые акты² в части квалификационных экзаменов, порядка лицензирования и

¹ Положение от 18.01.2016 № 529-П.

Рисунок 1.3

Количество клиентов профучастников по видам деятельности на конец первого квартала 2016 года



Источник: Банк России

саморегулируемых организаций. Подобная деятельность регулятора направлена на совершенствование нормативно-правовой базы, что позволит повысить прозрачность рынка.

Брокеры, дилеры и доверительные управляющие

Общее количество клиентов профессиональных участников рынка ценных бумаг за первые три месяца 2016 года увеличилось на 18% и составило 2,8 млн, при этом 97,7% из них составляют физические лица. Число активных (т.е. совершивших хотя бы одну сделку за отчетный период) клиентов достигло 254,3 тыс. (9% от общего количества клиентов).

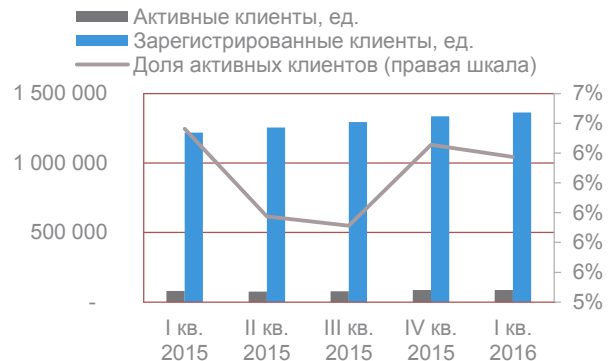
Общее количество клиентов профучастников-НФО за первый квартал 2016 года незначительно увеличилось, оставшись на уровне 1,3 млн (+1% к началу года). Число активных клиентов профучастников-НФО сохранилось на уровне конца года и составило 12% от общего числа клиентов.

Профучастники-КО привлекали клиентов гораздо активнее – так, общее число их клиентов за первые три месяца 2016 года увеличилось на 40%, количество активных клиентов – на 67% (общее количество составило 1,5 млн

² Указания Банка России от 18.01.2016 №№ 3937-У, 3938-У, 3939-У, а также Указание Банка России от 05.02.2016 № 3956-У.

Рисунок 1.4

Динамика среднего за квартал количества клиентов участников торгов на фондовом рынке Группы «Московская Биржа» (ед.)



Источник: Московская Биржа

и 92,6 тысяч клиентов соответственно)

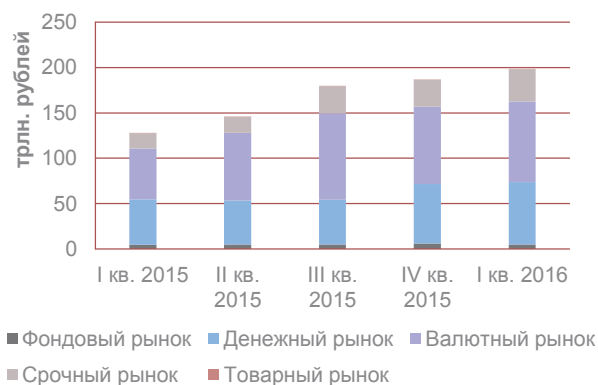
В разрезе видов деятельности структура клиентов профучастников-НФО распределена неравномерно: услуги депозитарного обслуживания получают 51% клиентов (-1,1 п.п. к уровню конца 2015 года), 48% клиентов заключили договоры брокерского обслуживания (+1 п.п.), на долю доверительного управления приходится менее 2% клиентов (+0,1 п.п.). При этом в части доверительного управления количество активных клиентов сокращалось (-13% к уровню конца 2015 года), а в части брокерского обслуживания, напротив, росло (+6%).

В структуре клиентов профучастников-КО в части депозитарного обслуживания, на которое приходится 64% всех клиентов, наблюдается рост: количество клиентов увеличилось на 21% к уровню начала года. В части брокерского обслуживания (на этот вид деятельности приходится 36% клиентов) количество клиентов профучастников-КО практически удвоилось (+91%). В части доверительного управления, на которое приходится 0,1% всех клиентов, их количество сократилось на 5%, что является прямым результатом сочетания текущей экономической ситуации и высоких входных требований для получения клиента по доверительному управлению.

После активного роста в конце 2015 года,

Рисунок 1.5

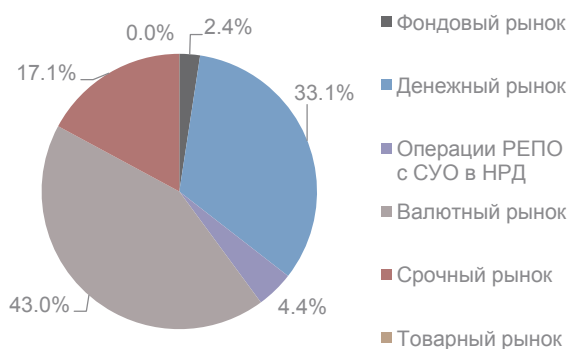
Динамика торгов на Московской Бирже в разрезе рынков



Источник: Московская Биржа

Рисунок 1.7

Структура торгов на Московской Бирже в разрезе рынков на конец первого квартала 2016 года, (%)



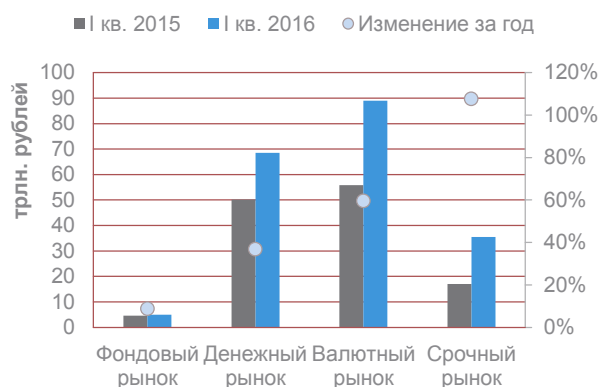
Источник: Московская Биржа

количество клиентов участников торгов на Московской бирже – как зарегистрированных, так и активных – за первые три месяца 2016 года практически не изменилось. По состоянию на конец первого квартала 2016 года на Московской бирже было зарегистрировано 1364,7 тыс. клиентов, количество уникальных клиентов составило 1038,2 тыс. Среднемесячное количество активных клиентов составило 87,0 тысяч (+0,8 п.п. к значению за IV квартал 2015 года).

По состоянию на 1 апреля 2016 года на Московской бирже было зарегистрировано более 110 тысяч индивидуальных инвестиционных счетов³ (ИИС). Около 30% из них принадлежит новым клиентам, ранее не торговавшим на бир-

Рисунок 1.6

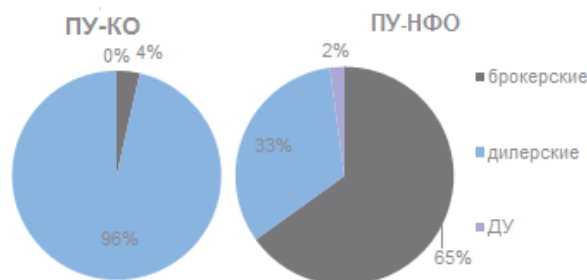
Динамика объемов торгов в разрезе рынков



Источник: Московская Биржа

Рисунок 1.8

Структура внебиржевых сделок профессиональных участников рынка ценных бумаг по видам деятельности на конец первого квартала 2016, (%)



Источник: Банк России

же. На долю топ-15 участников торгов в данном сегменте приходится почти 99% всех открытых счетов.

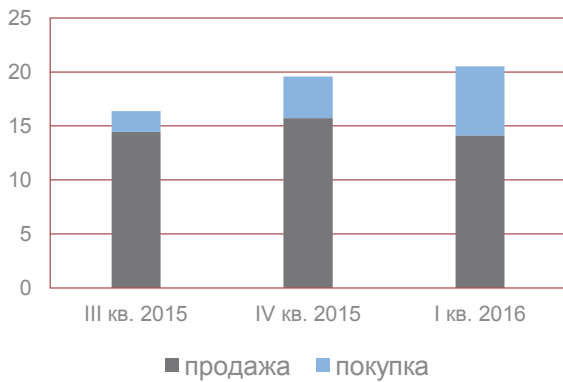
Общий объем торгов на Московской бирже в первом квартале 2016 года составил 207,2 трлн рублей, показав прирост на 52,2% по сравнению с соответствующим периодом прошлого года, – в основном, за счет роста объема торгов на валютном и денежном рынках.

На валютном рынке, на который приходится 43% объема биржевых торгов, рост обеспечили сделки по валютной паре доллар/рубли – объем кассовых сделок (спот) составил 31,7 трлн руб-

³ Статистика по сегменту приведена по данным Московской Биржи.

Рисунок 1.9

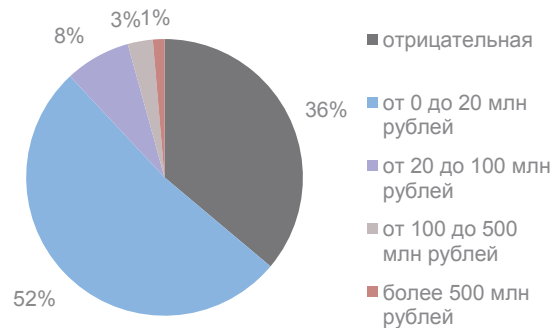
Структура внебиржевых сделок, заключенных в рамках генерального соглашения (собственные сделки), (трлн рублей)



Источник: Банк России

Рисунок 1.10

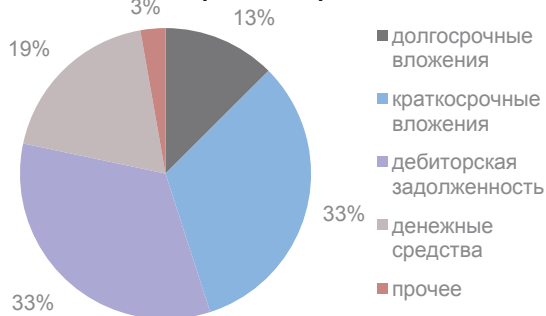
Распределение количества профучастников-НФО в зависимости от объема чистой прибыли за три месяца 2016 года (%)



Источник: Банк России

Рисунок 1.11

Структура активов профучастников-НФО на конец первого квартала 2016



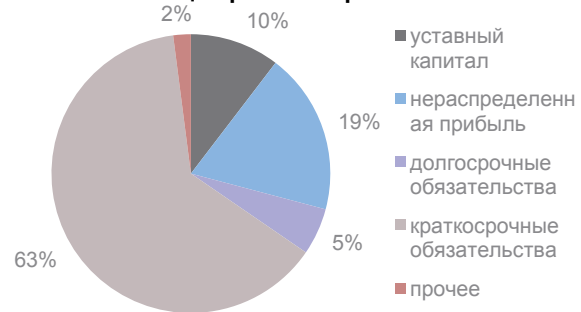
Источник: Банк России

лей (+70,5% к уровню первого квартала 2015 года), объем торгов по сделкам своп достиг 43,6 трлн рублей (+53,5%). На денежном рынке (33% биржевых торгов) драйверами роста были операции репо с ЦК (31,3 трлн рублей, +228,3% к уровню первого квартала 2015 года) – в основном, за счет облигаций (кроме ОФЗ). Одной из причин столь значительного роста объемов репо с ЦК стало введение в конце января 2016 года валютного репо с ЦК сроками исполнения до семи дней. Объемы торгов в рамках междилерского репо составили 12,8 трлн рублей (+21,0% к соответствующему периоду прошлого года), в то время как объемы прямого репо с Банком России сократились на 26,9%, до 15,9 трлн рублей.

Объем торгов на срочном рынке (17% общего объема торгов) показал почти двукрат-

Рисунок 1.12

Структура пассивов профучастников-НФО на конец первого квартала 2016



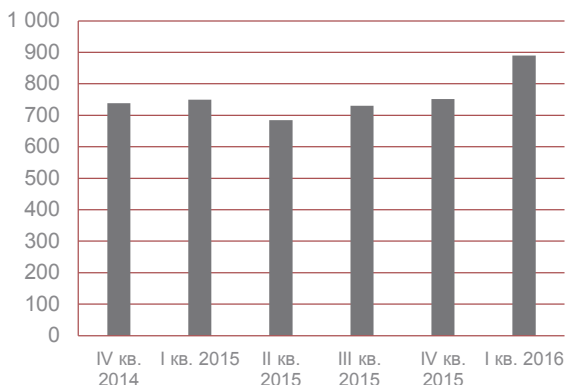
Источник: Банк России

ный рост по сравнению с первым кварталом 2015 года и достиг 35,5 трлн рублей, главным образом, за счет валютных фьючерсов (23,0 трлн рублей). В разрезе контрактов наибольший рост показали товарные фьючерсы – их объем увеличился в четыре раза, с 18,3 млн до 98,0 млн. Среди основных причин всплеска интереса к товарным деривативам можно назвать динамику нефтяных котировок и цен на золото.

Фондовый рынок, на который приходится чуть более 2% общего объема торгов, в первом квартале 2016 года показал самые скромные годовые темпы прироста – 8,7%, до 5,0 трлн рублей. В этом сегменте рос только ры-

⁴С учетом сделок кредитных организаций, без сделок РЕПО, без сделок, информация о которых направляется в репозиторий.

Рисунок 1.13

Совокупные активы профучастников-НФО
(млрд руб.)

Источник: Банк России

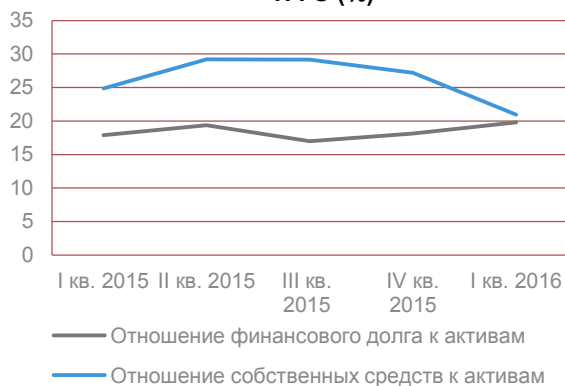
нок облигаций в части вторичных торгов ОФЗ (1,3 трлн рублей, +113,4% к уровню первого квартала 2015 года). Объем размещений ОФЗ также показал более чем двукратный прирост, однако за первые три месяца 2016 года составил всего 242,9 млрд рублей.

На внебиржевом рынке совокупные обороты по покупке и продаже в первом квартале 2016 года составили 7,8 трлн рублей, что значительно меньше уровня прошлого квартала (33,3 трлн рублей). Снижение обусловлено изменениями показателей профучастников-НФО: их совокупные обороты по внебиржевым сделкам за три месяца 2016 года сократились на 91%, до 2,3 трлн рублей. В структуре внебиржевых сделок профучастников-НФО более половины приходится на брокерские сделки (1,5 трлн рублей или 65,1% совокупных оборотов). Совокупные обороты профучастников-кредитных организаций составляют 5,5 трлн рублей (70,3% общих оборотов), доминирующая часть которых приходится на дилерские сделки – их доля достигла 96,4%.

Внебиржевые обороты по сделкам репо, заключенным в рамках генерального соглашения, в первом квартале 2016 года составили 20,5 трлн рублей, две трети из них составляют сделки, в которых профучастники выступали в качестве продающей стороны.

Чистая прибыль профучастников-НФО за

Рисунок 1.14

Динамика коэффициентов, отражающих уровень
финансовой независимости профучастников-
НФО (%)

Источник: Банк России

первые три месяца 2016 года составила 23,7 млрд рублей.

Совокупные активы профучастников-НФО показали прирост на 18,8% относительно соответствующего периода прошлого года и достигли 890,1 млрд рублей (1,1% ВВП).

В структуре активов профучастников-НФО изменения незначительны, краткосрочные финансовые вложения и дебиторская задолженность составляют по трети совокупного портфеля. Такое распределение долей типично для этого вида деятельности: в частности, требования по сделкам с ценными бумагами отражаются как дебиторская задолженность, а в состав краткосрочных финансовых вложений включается портфель ценных бумаг.

В структуре пассивов профучастников-НФО преобладают краткосрочные обязательства – их доля составляет 63%, а объем достигает 564,3 млрд. рублей. Нераспределенная прибыль (с учетом сальдированной нераспределенной прибыли прошлых лет) на конец первого квартала 2016 года составила 166,9 млрд рублей или 19% пассивов.

Объем собственных средств профучастников - НФО, рассчитанных с учетом поправочных коэффициентов⁵, по сравнению с соответствующим периодом прошлого года незначительно сократился и составил 182,0 млрд рублей (-1,3 п.п.). При этом отношение собственных средств к

активам за год сократилось на 3,9 п.п. и на конец первого квартала 2016 года составляет 21%. Отношение финансового долга к активам, напротив, выросло на 1,9 п.п., до 19,8%.

Регистраторы

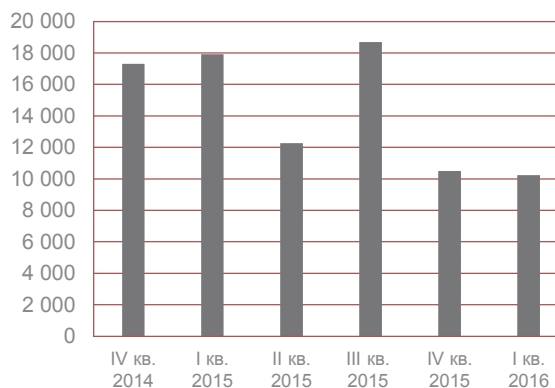
Количество регистраторов в первом квартале 2016 года сократилось на одну организацию – до 38 компаний. При этом общее количество обслуживаемых реестров за аналогичный период сократилось на 1%, до 62,8 тыс. реестров, а общее количество зарегистрированных сохранилось на уровне 35,9 млн. единиц. При этом количество зарегистрированных лиц, на счетах которых учитываются ценные бумаги, составляет 25,2 млн единиц.

Объем активов регистраторов остался на уровне конца 2015 года (-42,9% относительно первого квартала 2015 года) и составил 10,2 млрд. рублей. В структуре активов преобладают денежные средства (34,6%) и краткосрочные вложения (19,4%). Доля дебиторской задолженности и долгосрочных вложений составляет 12,7% и 10,4% соответственно.

В первом квартале 2016 года регистраторы показали чистый убыток 87,6 млн. рублей, что связано, в первую очередь, с высокой долей управленческих расходов (85% валовой прибыли).

Рисунок 1.15

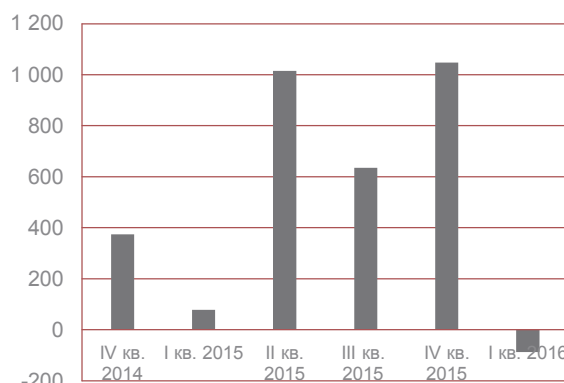
Совокупные активы регистраторов (млрд руб.)



Источник: Банк России

Рисунок 1.16

Чистая прибыль регистраторов за три месяца
2016 года (млн рублей)



Источник: Банк России

⁵ В соответствии с Указанием Банка России от 15.01.2015 №3533-У, Положением «О порядке расчета собственных средств профессиональных участников рынка ценных бумаг, управляющих компаний инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов, товарных бирж и биржевых посредников, заключающих в биржевой торговле договоры, являющиеся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является биржевой товар» (утв. Приказом ФСФР от 23.10.2008 №08-41/пз-н).

2. КЛЮЧЕВЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ ПРОФЕССИОНАЛЬНЫХ УЧАСТНИКОВ РЫНКА ЦЕННЫХ БУМАГ

	Единица измерения	1 кв. 2015	2 кв. 2015	3 кв. 2015	4 кв. 2015	1 кв. 2016	Изменение за год, %
Количество кредитных и некредитных организаций, имеющих лицензию профессионального участника рынка ценных бумаг	ед.	1 039	832	933	875	832	-19,9
Количество НКО - профессиональных участников рынка ценных бумаг	ед.	617	475	540	501	475	-23,0
Количество КО - профессиональных участников рынка ценных бумаг	ед.	422	357	393	374	357	-15,4
Количество ПУ-НКО с лицензией на ведение реестра владельцев ценных бумаг	ед.	40	40	39	39	38	-5,0
Концентрация							
Количество компаний, совместно контролирующих 80% активов (профучастники-НКО)	ед.	55	51	45	38,0	31,0	-43,6
Количество компаний, совместно контролирующих 80% активов (профучастники-НКО)	%	8,9	10,7	8,3	7,6	6,5	-2,4
Активы	млн руб.	767182,5	697107,3	748823,7	761785,7	900359,7	17,4
в том числе профессиональных участников рынка ценных бумаг (без регистраторов)	млн руб.	749 270,5	684 845,8	730 132,6	751 289,5	890 130,5	18,8
в том числе ПУ-НКО с лицензией на ведение реестра владельцев ценных бумаг	млн руб.	17 912,1	12 261,5	18 691,1	10 496,3	10 229,2	-42,9
Отношение активов к ВВП	%	1,0	0,9	0,9	0,9	1,1	0,1
Собственные средства	млн руб.	190685,3	203716,4	218282,6	207362,1	188812,6	-1,0
в том числе профессиональных участников рынка ценных бумаг (без регистраторов)	млн руб.	184 435,3	196 967,7	211 677,5	201 131,7	182 025,3	-1,3
в том числе ПУ с лицензией на деятельность по ведению реестра владельцев ценных бумаг	млн руб.	6 250,0	6 748,8	6 605,1	6 230,4	6 787,3	8,6

	Единица измерения	1 кв. 2015	2 кв. 2015	3 кв. 2015	4 кв. 2015	1 кв. 2016	Изменение за год, %
Капитал и резервы	млн руб.		256479,5	281869,7	262757,2	285784,5	
в том числе профессиональных участников рынка ценных бумаг (без регистраторов)	млн руб.		247 922,3	272 797,1	254 136,0	277 178,6	
в том числе ПУ с лицензией на деятельность по ведению реестра владельцев ценных бумаг	млн руб.		8 557,2	9 072,6	8 621,3	8 605,8	
Обязательства по основному виду деятельности (краткосрочные кредиты и займы)	млн руб.	102007,0	102385,6	90106,4	100003,8	136593,1	33,9
в том числе профессиональных участников рынка ценных бумаг (без регистраторов)	млн руб.	102 003,0	102 384,2	90 102,2	100 002,4	136 592,2	33,9
в том числе ПУ с лицензией на деятельность по ведению реестра владельцев ценных бумаг	млн руб.	4,0	1,4	4,2	1,4	0,9	-77,6
Прочие обязательства	млн руб.		338242,3	376847,6	399024,7	477982,1	
в том числе профессиональных участников рынка ценных бумаг (без регистраторов)	млн руб.		334 539,4	367 233,3	397 151,1	476 359,7	
в том числе ПУ с лицензией на деятельность по ведению реестра владельцев ценных бумаг	млн руб.		3 702,9	9 614,3	1 873,6	1 622,5	
Кредиторская задолженность	млн руб.	347732,5	281579,0	315598,0	335542,7	416496,1	19,8
в том числе профессиональных участников рынка ценных бумаг (без регистраторов)	млн руб.	345 038,6	278 070,5	306 181,1	334 369,3	415 157,8	20,3
в том числе ПУ с лицензией на деятельность по ведению реестра владельцев ценных бумаг	млн руб.	2 693,9	3 508,5	9 416,9	1 173,3	1 338,2	-50,3
Запас капитала	%	186,9	199,0	242,2	207,4	138,2	-48,7
Отношение собственных средств к активам	%	24,9	29,2	29,2	27,2	21,0	-3,9
Долгосрочные кредиты и займы	млн руб.	35 356,1	32 849,4	37 120,9	38 093,0	41 872,9	18,4
в том числе профессиональных участников рынка ценных бумаг (без регистраторов)	млн руб.	35 356,1	32 849,4	37 120,9	38 093,0	41 872,0	18,4
в том числе ПУ с лицензией на деятельность по ведению реестра владельцев ценных бумаг	млн руб.	0,0	0,0	0,0	0,0	0,9	
Размер финансового долга (долгосрочные + краткосрочные займы)	млн руб.	137 363,1	135 235,0	127 227,3	138 096,7	178 466,0	29,9
Отношение финансового долга к активам	%	17,9	19,4	17,0	18,1	19,8	1,9
Чистая прибыль за отчетный период с начала отчетного года	млн руб.	244,5	4004,0	28747,0	23121,4	23662,0	9577,0
в том числе профессиональных участников рынка ценных бумаг (без регистраторов)	млн руб.	166,2	2 988,5	28 112,0	22 073,2	23 749,6	14 191,3
в том числе ПУ с лицензией на деятельность по ведению реестра владельцев ценных бумаг	млн руб.	78,3	1 015,5	635,0	1 048,2	-87,6	

3. МЕТОДИЧЕСКИЕ ПОЯСНЕНИЯ К КЛЮЧЕВЫМ ПОКАЗАТЕЛЯМ ПРОФЕССИОНАЛЬНЫХ УЧАСТНИКОВ РЫНКА ЦЕННЫХ БУМАГ

Общие положения

В таблице «Ключевые показатели профессиональных участников рынка ценных бумаг» представлена динамика изменения агрегированных показателей, характеризующих деятельность некредитных финансовых организаций, имеющих лицензию профессионального участника рынка ценных бумаг (далее – ПУ), в том числе лицензию на осуществление деятельности по ведению реестра (далее – регистратор): количество некредитных финансовых организаций (количество кредитных финансовых организаций), имеющих лицензии профессиональных участников рынка ценных бумаг, активы профессиональных участников рынка ценных бумаг, собственные средства профессиональных участников рынка ценных бумаг, обязательства по основному виду деятельности профессиональных участников рынка ценных бумаг, прочие обязательства, кредиторская задолженность, нераспределенная прибыль (непокрытый убыток), долгосрочные кредиты и займы, запас капитала.

Показатели формируются на основе агрегированных данных квартальных отчетов профессиональных участников рынка ценных бумаг (форма № 1100), представившихся в Банк России в соответствии с Постановлением ФКЦБ РФ № 33, Минфина РФ № 109н от 11.12.2001, отчетов профессиональных участников рынка ценных бумаг, представляемых в Банк России в соответствии с Указанием ЦБ РФ от 15.01.2015 № 3533-У, отчетов кредитных организаций, представляемых в Банк России в соответствии с Указанием ЦБ РФ от 12.11.2009 № 2332-У.

При формировании данных по профессиональным участникам рынка ценных бумаг некредитным финансовым организациям отдельно учитывались организации, имеющие лицензии на осуществление функций финансового посредничества на рынке ценных бумаг (лицензия на

осуществление брокерской деятельности, лицензия на осуществление дилерской деятельности, лицензия на осуществление деятельности по доверительному управлению) в сочетании с лицензиями на другие виды профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг, а также компании, выполняющие функции регистратора.

Характеристика отдельных показателей

Собственные средства – сумма собственных средств ПУ, величина которых рассчитывается в соответствии с Указанием Банка России от 15.01.2015 №3533-У и Приказом ФСФР от 23.10.2008 №08-41/пз-н.

Активы – часть формы 0420410 «Показатели бухгалтерского баланса», отражающая состав и стоимость имущества ПУ на определенную дату. Активы ПУ представляют собой сумму следующих видов активов по всем ПУ: внеоборотные активы (нематериальные активы, основные средства, незавершенное строительство, доходные вложения в материальные ценности, долгосрочные финансовые вложения, прочие внеоборотные активы), оборотные активы (запасы и затраты, НДС по приобретенным ценностям, дебиторская задолженность, задолженность участников (учредителей) по взносам в уставный капитал, собственные акции, выкупленные у акционеров, краткосрочные финансовые вложения, денежные средства прочие оборотные активы).

Дебиторская задолженность – часть раздела II. «Оборотные активы» формы 0420410 «Показатели бухгалтерского баланса». Дебиторская задолженность представляет собой сумму обязательств перед ПУ, платежи по которой ожидаются более чем через 12 месяцев после отчетной даты, и обязательства, платежи по которым ожидаются в течение 12 месяцев после отчетной даты (размер дебиторской задолженности контрагентов по договорам купли-продажи ценных бу-

маг, заключенным организацией от своего имени и за свой счет; размер дебиторской задолженности по договорам купли-продажи ценных бумаг, заключенным организацией от своего имени и за счет клиентов - физических лиц; размер дебиторской задолженности по договорам купли-продажи ценных бумаг, заключенным организацией от своего имени и за счет клиентов - юридических лиц).

Денежные средства - часть раздела II. «Оборотные активы» формы 0420410 «Показатели бухгалтерского баланса», представляющая собой сумму денежных средств, имеющихся у ПУ в российской и иностранных валютах, находящихся в том числе в кассе, на расчетных и валютных счетах ПУ (денежные средства по договорам на брокерское обслуживание, на управление ценными бумагами).

Краткосрочные финансовые вложения – часть раздела II. «Оборотные активы» формы 0420410 «Показатели бухгалтерского баланса», представляющая собой сумму финансовых вложений ПУ, в том числе сумму:

предоставленных займов;

финансовых вложений в организации, в уставном (складочном) капитале которых профессиональному участнику принадлежит более 10 процентов акций (долей, паев), за исключением эмиссионных ценных бумаг таких организаций, допущенных к обращению через организаторов торговли;

финансовых вложений в уставный (складочный) капитал участников (акционеров, учредителей, членов) профессионального участника, за исключением эмиссионных ценных бумаг, допущенных к обращению через организаторов торговли;

эмиссионных ценных бумаг российских эмитентов, выпуски которых не зарегистрированы в установленном законодательством Российской Федерации порядке, а также финансовых вложений в организации, которые на момент подачи заявления ликвидированы или признаны несостоятельными (банкротами) в установленном законодательством порядке;

векселей организаций, эмиссионные ценные бумаги которых не допущены к обращению через организаторов торговли, имеющих соответствующую лицензию Банка России.

Краткосрочные обязательства – сумма раздела V формы 0420410 «Показатели бухгалтерского баланса» ПУ, включающего следующие строки: займы и кредиты, кредиторская задолженность, прочие кредиты, задолженность участникам (учредителям) по выплате доходов, доходы будущих периодов, резервы предстоящих расходов, прочие краткосрочные обязательства.

Обязательства по основному виду деятельности - сумма строки 610 «Займы и кредиты» раздела V. «Краткосрочные обязательства» формы 0420410 «Показатели бухгалтерского баланса» по всем ПУ.

Прочие обязательства – разность между суммой активов ПУ, суммой обязательств по основному виду деятельности и суммой капитала и резервов.

Чистая прибыль – сумма строки 2400 формы 0420411 «Показатели отчета о финансовых результатах» по всем ПУ.

Запас капитала – соотношение суммы собственных средств ПУ и суммы обязательств по основному виду деятельности ПУ по итогам отчетного периода, выраженное в процентах.

Финансовый долг – сумма обязательств по основному виду деятельности и строки 510 «Займы и кредиты» раздела IV. «Долгосрочные обязательства» формы 0420410 «Показатели бухгалтерского баланса» по всем ПУ.

Количество договоров (в том числе активных договоров) на брокерское обслуживание у профессиональных участников рынка ценных бумаг (на управление ценными бумагами, на депозитарное управление) представляет собой количество клиентов, заключивших договоры с профессиональными участниками рынка ценных бумаг на оказание соответствующих услуг. Активные договоры – договоры, в соответствии с которыми в отчет-

ном месяце совершена хотя бы одна сделка.

Объем вторичных торгов ценными бумагами (без учета сделок РЕПО) на Московской Бирже представляет собой среднее арифметическое значение сделок по покупке и сделок по продаже ценных бумаг.

Объем внебиржевых торгов представляет собой среднее арифметическое значение сделок по покупке и продаже ценных бумаг, совершенных профессиональными участниками рынка ценных бумаг.

Клиенты участников торгов на фондовом рынке Группы «Московская Биржа» - юридические и физические лица, зарегистрированные в Системе торгов ФБ ММВБ на основании данных, полученных от участников торгов ФБ ММВБ или от клиринговой организации.

Активные клиенты участников торгов на фондовом рынке Группы «Московская Биржа» - количество клиентов участников торгов, совершивших на бирже в течение месяца хотя бы одну сделку.

Зарегистрированные клиенты участников торгов на фондовом рынке Группы «Московская Биржа» - количество брокерских счетов, открытых участниками торгов на фондовом рынке Группы «Московская Биржа» своим клиентам.

