



Банк России

Центральный банк Российской Федерации



II КВАРТАЛ 2018

Информационно-
аналитические
материалы

**ОБЗОР КЛЮЧЕВЫХ
ПОКАЗАТЕЛЕЙ
ПАЕВЫХ И АКЦИОНЕРНЫХ
ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ**

Москва

СОДЕРЖАНИЕ

1. ПАЕВЫЕ ИНВЕСТИЦИОННЫЕ ФОНДЫ	2
Закрытые паевые инвестиционные фонды	7
Открытые паевые инвестиционные фонды	9
Интервальные паевые инвестиционные фонды.....	11
2. КЛЮЧЕВЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ ПАЕВЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ И АКЦИОНЕРНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ.....	13
3. МЕТОДИЧЕСКИЕ ПОЯСНЕНИЯ К КЛЮЧЕВЫМ ПОКАЗАТЕЛЯМ ПАЕВЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ И АКЦИОНЕРНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ	22

Настоящий обзор подготовлен Департаментом исследований и прогнозирования и Департаментом обработки отчетности.

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

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

1. ПАЕВЫЕ ИНВЕСТИЦИОННЫЕ ФОНДЫ¹

В II квартале 2018 г. чистый приток инвестиций в ПИФы продолжился и составил 92,5 млрд руб.², что опередило значение как предыдущего квартала, так и аналогичного периода 2017 года. Более половины нетто-притока пришлось на ЗПИФы (53,0%), 44,0% – на ОПИФы. Однако в случае сохранения в целом умеренного уровня средневзвешенной доходности открытых фондов на фоне возможного роста ставок по депозитам темпы прироста средств в ОПИФы могут замедлиться.

- Стоимость чистых активов ПИФов (СЧА) за квартал увеличилась на 3,0%, до 3107,1 млрд рублей. Сопоставимыми темпами выросло совокупное количество владельцев паев ПИФов – на 3,5%, при этом наибольшее усиление спроса по-прежнему наблюдается в ОПИФах – увеличение числа пайщиков составило 11,6%.
- Такая динамика в том числе объясняется более активным предложением некоторыми кредитными организациями паев фондов своим клиентам, что позволяет им получить дополнительный комиссионный доход. Так, в топ-5 ОПИФов³ по СЧА входят фонды, управляющие компаниями которых связаны с крупными банками.
- Рост СЧА открытых фондов в II квартале 2018 г. объясняется прежде всего значительным объемом выдачи паев (54,5 млрд руб.), который более чем в два раза превышает показатель за аналогичный период 2017 г. (для сравнения: прирост взносов по инвестиционному страхованию жизни был ниже и составил 37,9%).
- В II квартале 2018 г. основным изменением в структуре активов ОПИФов стал рост долей вложений в облигации. При этом на фоне ухудшения конъюнктуры, вызванного внешними факторами, динамика рынка корпоративных и государственных облигаций ухудшилась.
- В результате ухудшения ситуации на рынке облигаций и в связи с высокой долей этого инструмента в портфелях открытых фондов средневзвешенная доходность ОПИФов снизилась и составила 6,2% (кварталом ранее – 12,9%, годом ранее – 6,3%). Доходность топ-5 ОПИФов по СЧА⁴ за апрель-июнь 2018 г. находилась в диапазоне от -4,2 до +1,2% годовых.

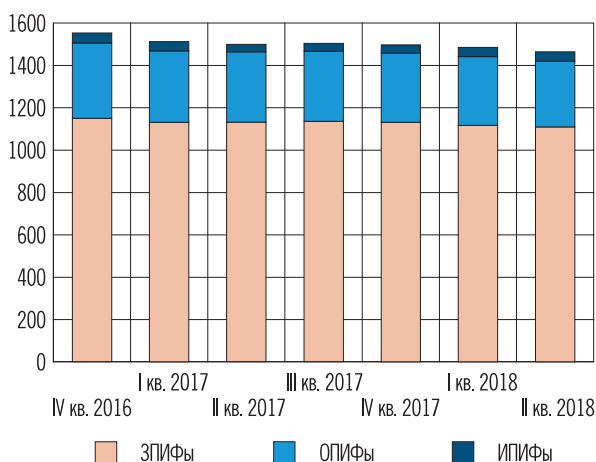
¹ Обзор подготовлен на основе данных отчетности, предоставленной управляющими компаниями 1286 ПИФов и двух АИФов по состоянию на 12.12.2018.

² С II квартала 2018 г. отчетность предоставляется в соответствии с Указанием Банка России от 8.02.2018 № 4715-У «О формах, порядке и сроках составления и представления в Банк России отчетов акционерными инвестиционными фондами, управляющими компаниями инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов» (далее – Указание Банка России № 4715-У).

³ Для неквалифицированных инвесторов http://www.cbr.ru/finmarket/supervision/sv_coll/.

⁴ Для неквалифицированных инвесторов http://www.cbr.ru/finmarket/supervision/sv_coll/.

Рисунок 1
Количество зарегистрированных ПИФов по типам (ед.)



Источник: Банк России.

В II квартале 2018 г. количество зарегистрированных ПИФов⁵ уменьшилось на 21, до 1464. Негативное влияние на динамику оказало сокращение количества открытых ПИФов на 13 единиц и закрытых ПИФов на 8 единиц. Количество ИПИФов не изменилось и составило 43. Количество фондов для квалифицированных инвесторов увеличилось на 10, до 796.

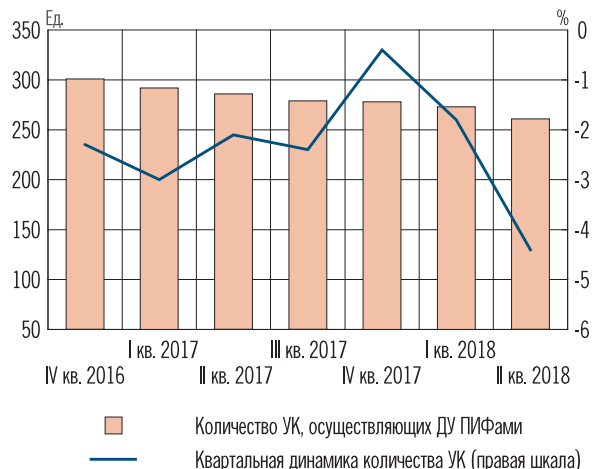
Количество фондов, отчетность которых была использована при подготовке обзора, составило 1286. При этом количество фондов для квалифицированных инвесторов было равно 734.

В II квартале 2018 г. вступило в силу указание, определяющее требования к отчету по прекращению ПИФа⁶, а также указание, устанавливающее требования к определению и раскрытию расчетной цены одного

⁵ Обзор подготовлен на основе данных отчетности, предоставленной управляющими компаниями 1286 ПИФов и двух АИФов по состоянию на 20.08.2018.

⁶ Указание Банка России от 31.01.2018 №4712-У «О требованиях к отчету о прекращении паевого инвестиционного фонда и порядку его представления, а также об объеме, о сроках и форме его представления в Банк России» (зарегистрировано в Минюсте России 17.04.2018).

Рисунок 2
Количество управляющих компаний, осуществляющих доверительное управление ПИФаами



Источник: Банк России.

пая биржевого ПИФа⁷, который определяется как отношение разницы между стоимостью всех активов, составляющих фонд, и величиной всех обязательств, подлежащих исполнению за счет указанных активов, к количеству выданных паев биржевого фонда, рассчитанных на момент определения цены пая.

Концентрация активов незначительно выросла: за II квартал 2018 г. доля ПИФов, входящих в топ-100 по СЧА, выросла на 1 п.п., до 69,3%, а доля топ-20 – на 0,2 п.п., до 38,5%.

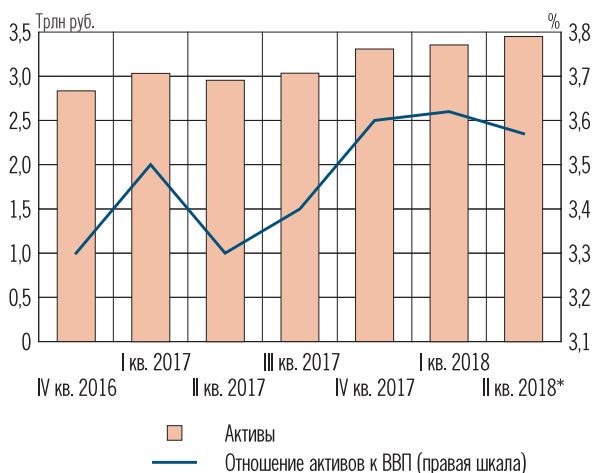
Количество компаний, управляющих ПИФаами (УК), также уменьшилось. На конец II квартала 2018 г. на рынке работала 261 управляющая компания (-12 единиц за квартал).

По итогам II квартала 2018 г. совокупный объем активов фондов вырос на 2,7%, до 3447,0 млрд рублей. Отношение этих средств к ВВП за последние 12 месяцев со-

⁷ Указание Банка России от 31.01.2018 №4713-У «О требованиях к правилам определения и раскрытия расчетной цены одного инвестиционного фонда, содержащимся в договоре, на основании которого осуществляется допуск инвестиционных паев биржевого паевого инвестиционного фонда к организованным торгам» (зарегистрировано в Минюсте России 5.04.2018).

Динамика активов ПИФов

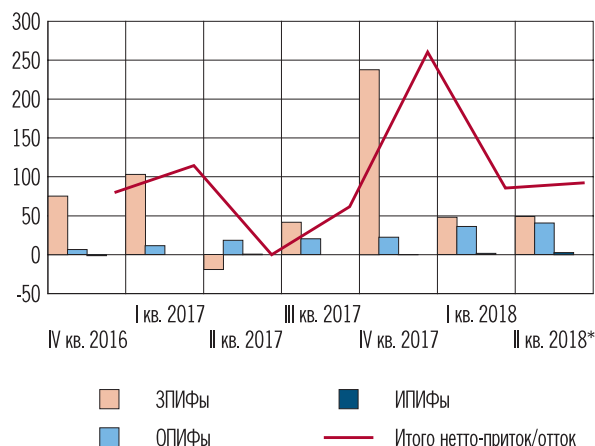
Рисунок 3



* Отчетность предоставлена в соответствии с Указанием Банка России № 4715-У.
Источник: Банк России.

Чистая выдача/погашение инвестиционных паев (млрд руб.)

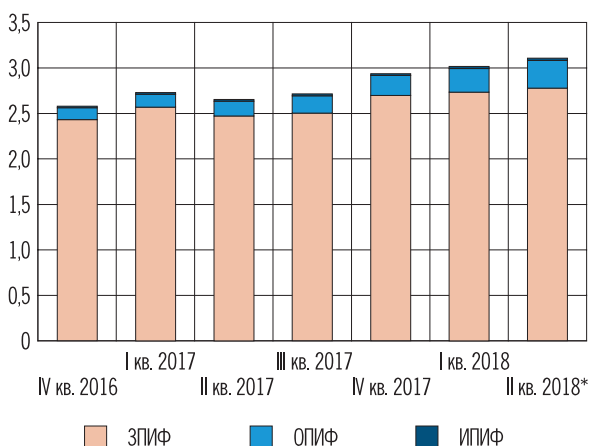
Рисунок 5



* Отчетность предоставлена в соответствии с Указанием Банка России № 4715-У.
Источник: Банк России.

Стоимость чистых активов по типам ПИФов (трлн руб.)

Рисунок 4



* Отчетность предоставлена в соответствии с Указанием Банка России № 4715-У.
Источник: Банк России.

ставило 3,57%, что соответствует значению предыдущего квартала.

СЧА ПИФов за отчетный квартал увеличилась схожими темпами (прирост составил 3,0%), до 3107,1 млрд рублей.

Наибольший вклад в рост СЧА ПИФов в II квартале 2018 г. внесла выдача инвестиционных паев ПИФов (+116,3 млрд руб.), доход по имуществу, составляющему паевой инвестиционный фонд (+31,6 млрд руб.), а также увеличение справедливой стоимости имущества (+25,6 млрд руб.). В то же время погашение паев ПИФов составило 23,8 млрд руб., выплата дохода по инвести-

ционным паям ПИФов – 15,8 млрд руб., расходы, связанные с доверительным управлением, были равны 6,7 млрд рублей.

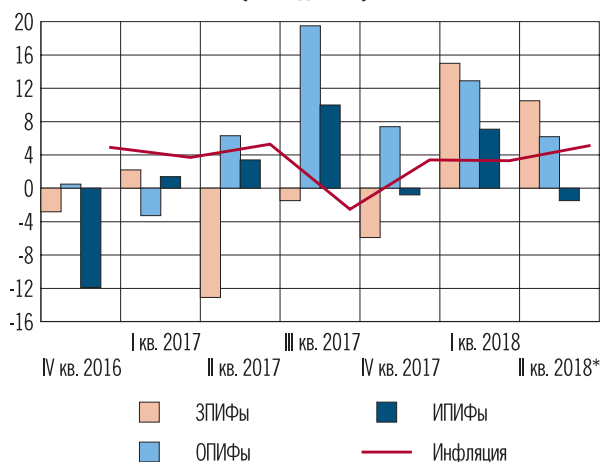
В II квартале 2018 г. нетто-приток инвестиций в ПИФы⁸ составил 92,5 млрд руб.⁹, что опередило как значение предыдущего квартала (85,9 млрд руб.), так и показатель за аналогичный период 2017 г. (0,05 млрд руб.). Более половины чистого притока пришлось на ЗПИФы (53,0%), 44,0% – на ОПИФы. Совокупное количество владельцев паев ПИФов в II квартале 2018 г. увеличилось на 3,5% (до 1610,1 тыс.). При этом наибольший рост спроса по-прежнему наблюдается в ОПИФах – увеличение числа пайщиков за квартал составило 11,6%, за год превысило 36% (523,3 тыс. на конец июня 2018 г.).

Средневзвешенная доходность ПИФов в II квартале 2018 г. составила 10,5% годовых при аннуализированной инфляции

⁸ Прирост имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) за вычетом уменьшения имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) по данным формы 0420503 Указания Банка России № 4715-У.

⁹ С II квартала 2018 г. отчетность предоставляется в соответствии с Указанием Банка России № 4715-У.

Рисунок 6
Динамика квартальной доходности ПИФов и инфляции (% годовых)



* Отчетность предоставлена в соответствии с Указанием Банка России № 4715-У.

Источник: Банк России.

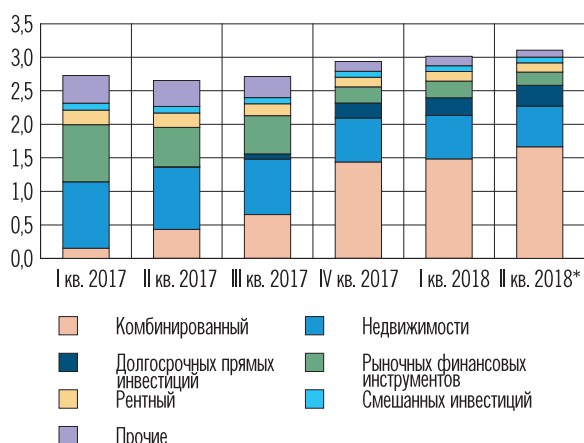
в 5,1% годовых. Для сравнения: доходности ПИФов за предыдущий квартал и аналогичный период 2017 г. были равны +14,8% и -12,0% годовых соответственно. Доходность крупнейшего сектора по СЧА – ЗПИФов – составила 11,1% годовых. Средневзвешенные доходности ОПИФов и ИПИФов были равны 6,2 и -1,5% годовых.

В то же время средневзвешенная процентная ставка вкладов физических лиц¹⁰ за год сократилась и находилась на уровне

ниже доходности ПИФов: так, по вкладам до 1 года (кроме «до востребования») ставка сократилась на 0,9 п.п., до 5,4% за II квартал 2018 г., от 1 года до 3 лет – 1,1 п.п., до 5,9%. При этом в условиях роста популярности ПИФов на фоне снижения ставок по депозитам некоторые кредитные организации стали более активно предлагать своим клиентам приобретать паи фондов, что позволяет им получить дополнительный доход за счет комиссий. Такая синергия дает возможность управляющим компаниям значительно расширить круг потенциальных инвесторов за счет использования обширных агентских сетей банков. Так, по данным на конец II квартала 2018 г. в топ-5 ОПИФов¹¹ по СЧА входят фонды, управляющие компании которых связаны с крупными банками. Росту популярности вложений в ПИФы также способствует развитие удаленных каналов продаж¹².

Максимальное колебание долей по категориям ПИФов составило 4,4 процентного пункта в II квартале 2018 года. Комбинированные ПИФы сохраняют за собой первое место по доле СЧА (53,5%, +4,4 п.п. за квартал). Продолжают уступать пози-

Рисунок 7
Стоимость чистых активов по категориям ПИФов (трлн руб.)



* Отчетность предоставлена в соответствии с Указанием Банка России № 4715-У.

Источник: Банк России.

Рисунок 8
Структура активов ПИФов (трлн руб.)



* Отчетность предоставлена в соответствии с Указанием Банка России № 4715-У.

Источник: Банк России.

¹⁰ Раздел «Процентные ставки и структура кредитов и депозитов по срочности», http://www.cbr.ru/statistics/?Prtd=int_rat.

¹¹ Для неквалифицированных инвесторов, http://www.cbr.ru/finmarket/supervision/sv_coll/.

¹² <https://www.kommersant.ru/doc/3676202>.

ции фонды недвижимости (19,5% совокупной СЧА – 2,0 п.п. за квартал). В тройке лидеров по доле СЧА находятся также фонды рыночных финансовых инструментов (10,0%, + 1,2 п.п. за квартал).

Наиболее существенным изменением в структуре активов ПИФов за период стало уменьшение доли крупнейшего объекта инвестиций – недвижимости, которая за квартал снизилась еще на 5,8 п.п., до 22,1% активов на конец июня 2018 г. (го-

дом ранее – 35,4%). Одновременно продолжился рост доли облигаций российских эмитентов – на 0,8 п.п. за квартал, до 6,5% (годом ранее – 3,6%). В то же время на 0,5 п.п. выросла доля вложений в государственные ценные бумаги (до 1,3% активов). Доля вложений в акции увеличилась до 19,0% (+0,1 п.п.), а доля вкладов в уставные капиталы российских снизилась до 17,6% (-0,5 п.п.).

Закрытые паевые инвестиционные фонды

В II квартале 2018 г. количество ЗПИФов на рынке уменьшилось на восемь фондов и на конец июня составило 1109. В то же время количество фондов, отчетность которых была использована при подготовке обзора, составило 956.

Доля этого сектора по объему СЧА на рынке ПИФов продолжила сокращаться (на 1,3 п.п. за II квартал 2018 г., на 3,7 п.п. за год) и составила 89,4%. При этом СЧА ЗПИФов за отчетный квартал увеличилась на 1,6% (за год – на 12,4%), до 2,8 трлн рублей.

Прирост активов был обеспечен преимущественно выдачей инвестиционных паев (58,2 млрд руб.), получением дохода по имуществу, составляющему ПИФ (+26,5 млрд руб.), и полученным доходом в результате увеличения справедливой стоимости имущества (+24,4 млрд руб.). Выплата доходов по инвестиционным паям составила 15,8 млрд руб., уменьшение стоимости имущества в результате погашения инвестиционных паев было равно 9,2 млрд рублей. По итогам II квартала 2018 г. нет-

то-приток инвестиций в ЗПИФы составил 49,0 млрд рублей.

В структуре ЗПИФов наибольшую долю занимают комбинированные фонды: на конец июня 2018 г. их СЧА достигла 1650,0 млрд руб. (+12,1% за квартал), или 59,4% СЧА ЗПИФов. На втором месте находятся фонды недвижимости (доля в СЧА ЗПИФов – 21,9%), при этом стоимость чистых активов таких фондов снизилась отно-

Рисунок 10

Распределение СЧА ЗПИФов по категориям фондов (млрд руб.)

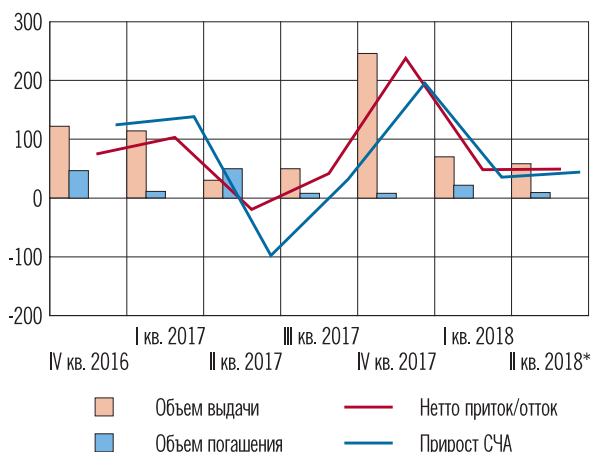


* Отчетность предоставлена в соответствии с Указанием Банка России № 4715-У.

Источник: Банк России.

Рисунок 9

Динамика СЧА, объемов выдачи и погашения инвестиционных паев ЗПИФов (млрд руб.)



* Отчетность предоставлена в соответствии с Указанием Банка России № 4715-У.

Источник: Банк России.

Рисунок 11

Доходность ЗПИФов (% годовых)



* Отчетность предоставлена в соответствии с Указанием Банка России № 4715-У.

Примечание: категории фондов указаны по убыванию доли СЧА в совокупной СЧА ЗПИФов на 30.06.2018.

Источник: Банк России.

нительно предыдущего квартала на 6,4%, до 607,3 млрд руб. (в том числе в связи со сменой фондами категорий). Третье место принадлежит фондам долгосрочных прямых инвестиций, СЧА которых также сократилась за квартал и составила 198,6 млрд руб. (7,2% от совокупной СЧА ЗПИФов).

Средневзвешенная доходность ЗПИФов в II квартале 2018 г. была равна 11,1% годовых (за январь-март 2018 г. – 15,0%, за апрель-июнь 2017 г. – -13,1%). При этом доходность комбинированных фондов со-

ставила 17,5% годовых, фондов недвижимости – 2,3%, фондов долгосрочных прямых инвестиций – 8,1%. Доходность комбинированных фондов наиболее волатильна – значение за I квартал 2018 г. достигало 25,5% (годом ранее оно опускалось до -48,4% годовых).

В структуре активов ЗПИФов наибольшие доли занимают недвижимость (24,5%), акции российских эмитентов (19,6%) и вклады в уставные капиталы российских организаций (19,5%).

Открытые паевые инвестиционные фонды

За II квартал 2018 г. количество ОПИФов уменьшилось на 13, до 312, а количество фондов, отчетность которых использовалась при подготовке обзора, составило 293.

При этом СЧА этого типа фондов за II квартал 2018 г. увеличилась на 17,1%, составив 303,7 млрд рублей. Доля этих фондов в структуре рынка выросла на 1,2 п.п. за квартал, до 9,8%, прирост за год составил 3,6 процентного пункта. На конец II квартала 2018 г., как и кварталом ранее, практически 100% СЧА открытых фондов приходится на фонды рыночных финансовых инструментов, несущественные доли занимают фонды смешанных инвестиций и фонды денежного рынка¹.

Рост СЧА в II квартале 2018 г. в первую очередь объясняется значительным объемом выдачи паев (54,5 млрд руб.), который более чем в два раза превышает показатель за аналогичный период предыдущего года и на 13,9% больше значения прошлого квартала. Для сравнения: прирост взносов по инвестиционному страхованию жизни в II квартале 2018 г. по сравнению со значением за тот же период 2017 г. был ниже (37,9%), объем взносов достиг 72,1 млрд рублей. В то время объем погашений паев составил 13,8 млрд рублей. В результате нетто-приток инвестиций в ОПИФы достиг 40,7 млрд рублей. Положительное влияние на СЧА также оказал доход по имуществу, составляющему ПИФ (+4,8 млрд руб.). Вознаграждение управляющей компании, специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, ауди-

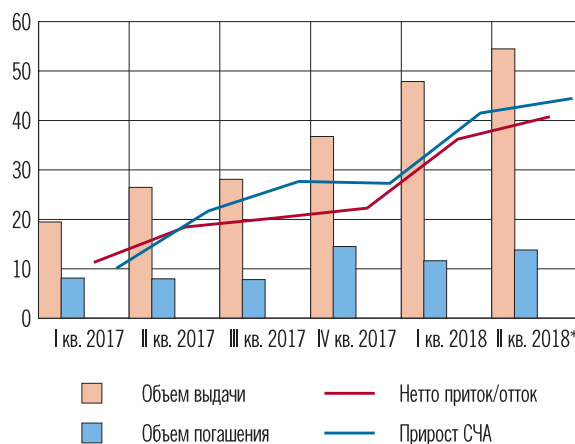
торской организации, оценщику и бирже составило 1,4 млрд рублей.

В II квартале 2018 г. основным изменением в структуре активов ОПИФов стал рост доли вложений в государственные облигации (+1,6 п.п., до 11,3% активов). Доля акций снизилась (на 1,0 п.п., до 11,6%), несмотря на рост объема вложений в этот тип активов (+8,7%). Доля облигаций российских эмитентов увеличилась на 0,6 п.п. и достигла 52,0%, доля иностранных ценных бумаг, напротив, снизилась и составила 17,7% (-0,2 п.п.).

Рост вложений в облигации произошел несмотря на ухудшение их динамики. Так, индекс суммарной доходности² корпоративных облигаций MICEXCBITR³ за квартал вырос на 1,3% годовых (в I квартале 2018 г. – 15,6% годовых, в 2017 г. – 12,3%). Индекс суммарной доходности государ-

Рисунок 12

Динамика СЧА, объемов выдачи и погашения инвестиционных паев ОПИФов (млрд руб.)



* Отчетность предоставлена в соответствии с Указанием Банка России № 4715-У.
Источник: Банк России.

¹ На данные категории приходятся фонды, которые находились в стадии прекращения. У таких фондов не было необходимости менять категорию. До тех пор пока деятельность таких фондов не прекратится, в отчетности будут фигурировать цифры по ним.

² Рассчитывается по методу совокупного дохода и чистых цен, то есть учитывает динамику цен облигаций, накопленный купонный доход и выплачиваемые купоны.

³ <http://www.moex.com/ru/index/MICEXCBITR/archive>.

Рисунок 13
Распределение СЧА ОПИФов по категориям фондов (млрд руб.)



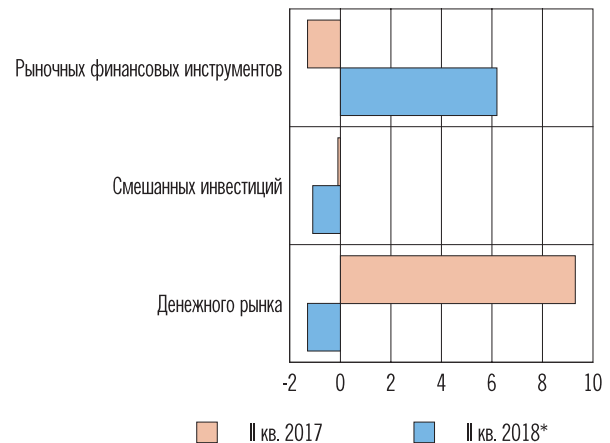
* Отчетность предоставлена в соответствии с Указанием Банка России № 4715-У.

Источник: Банк России.

ственных ценных бумаг RGBITR⁴ сократился на 6,5% годовых (в предыдущем квартале – 17,8%, в 2017 г. – 12,8%). На динамику показателей оказало влияние ухудшение конъюнктуры, вызванное внешними факторами. Увеличение вложений в акции произошло на фоне продолжающегося роста индекса акций MCFTR⁵ на 11,3% годовых за апрель-июнь 2018 г. (за I квартал – +34,6% годовых, за 2017 г. – -0,2%).

В результате ухудшения динамики облигационного рынка и в связи с высокой долей облигаций в портфелях средневзвешенная доходность ОПИФов в II квартале 2018 г. снизилась и составила 6,2% (кварталом ранее – 12,9%, годом ранее – 6,3%).

Рисунок 14
Доходность ОПИФов (% годовых)



* Отчетность предоставлена в соответствии с Указанием Банка России № 4715-У.

Примечание: категории фондов указаны по убыванию доли СЧА в совокупной СЧА ОПИФов на 30.06.2018.

Источник: Банк России.

Доходность топ-5 ОПИФов по СЧА за апрель-июнь 2018 г. находилась в диапазоне от -4,2 до +1,2% годовых⁶.

В случае сохранения в целом умеренного уровня средневзвешенной доходности открытых фондов на фоне роста ставок по депозитам в условиях увеличения ключевой ставки темпы прироста средств в ОПИФы могут замедлиться. При этом сохранение высоких темпов роста доходностей по акциям может подтолкнуть население к диверсификации своих вложений в надежде на рост доходности за счет покупки паев фондов с менее консервативными стратегиями.

⁴ <http://www.moex.com/ru/index/RGBITR/archive>.

⁵ <http://www.moex.com/ru/index/get-totalreturn.aspx?code=MCFTR>.

⁶ Для неквалифицированных инвесторов http://www.cbr.ru/finmarket/supervision/sv_coll/.

Интервальные паевые инвестиционные фонды

Количество ИПИФов в II квартале 2018 г. осталось без изменений (43). Однако число фондов, данные которых были использованы в обзоре, составило 37.

СЧА этого типа фондов за квартал выросла на 13,3%, достигнув 25,2 млрд рублей. Прирост за год был равен 28,5%. Однако доля ИПИФов на рынке остается незначительной (на конец июня 2018 г. – 0,8%, годом ранее – 0,7%). Прирост СЧА ИПИФов произошел за счет нетто-притока инвестиций в размере 2,8 млрд руб. (выдача паев составила 3,6 млрд при незначительном их погашении в размере 0,8 млрд руб.). Положительное влияние на динамику СЧА оказало также изменение справедливой стоимости имущества на 0,5 млрд рублей.

В II квартале 2018 г., как и кварталом ранее, крупнейшей по СЧА категорией интервальных фондов оставались комбинированных ИПИФы (54,4%, +5,5 п.п. за три месяца). На фонды рыночных финансовых инструментов пришлось 20,0% СЧА

(-2,6 п.п.), доля хедж-фондов составила 18,8% (-3,2 п.п.). Доли других категорий не превышали 4,1% СЧА ИПИФов.

Средневзвешенная доходность ИПИФов в II квартале 2018 г. была равна -1,5% годовых (кварталом ранее – 7,1%, годом ранее – 3,4%). Отрицательную доходность продемонстрировала крупнейшая категория фондов – комбинированные фонды (-8,8% годовых). Напротив, положительная доходность наблюдалась у второй и третьей категорий ИПИФов по величине СЧА – фондов рыночных финансовых инструментов и хедж-фондов – на уровне 3,3 и 11,5% годовых соответственно.

На первое место по объему инвестирования средств ИПИФов вышли иностранные ценные бумаги (на конец II квартала 2018 г. – 27,3%), доля которых в структуре активов ИПИФов выросла на 1,8 процентного пункта. На второе место опустились акции российских эмитентов (26,7% в структуре портфеля, – 8,9 п.п. за квартал). На третьем месте находятся государствен-

Рисунок 15



* Отчетность предоставлена в соответствии с Указанием Банка России № 4715-У.

Источник: Банк России.

Рисунок 16

Доходность ИПИФов (% годовых)



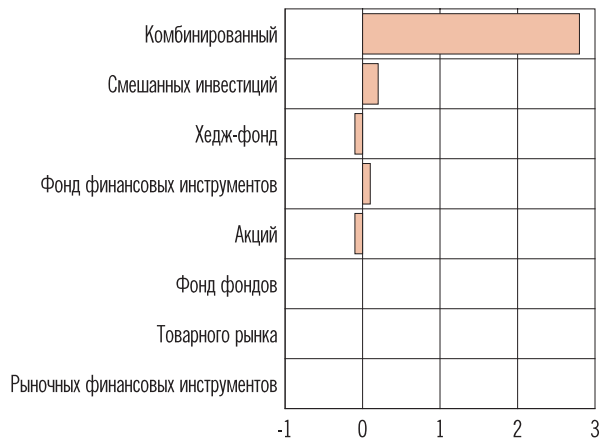
* Отчетность предоставлена в соответствии с Указанием Банка России № 4715-У.

Примечание: категории фондов указаны по убыванию доли СЧА в совокупной СЧА ИПИФов на 30.06.2018.

Источник: Банк России.

Рисунок 17

Динамика СЧА отдельных категорий ИПИФов в II квартале 2018 г. (млрд руб.)



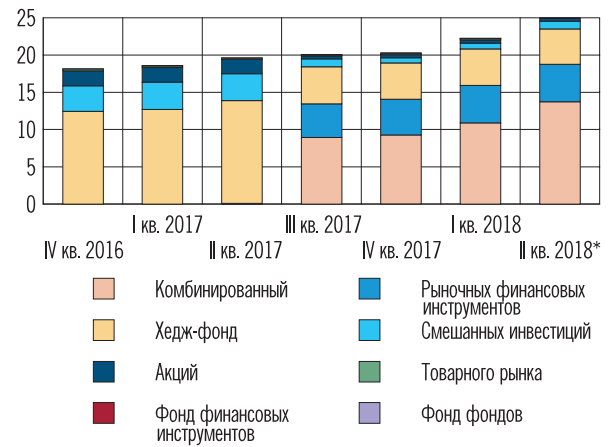
Примечание: категории фондов указаны по убыванию доли СЧА ИПИФов на 30.06.2018.

Источник: Банк России.

ные ценные бумаги (18,7%). Значительные доли также приходятся на облигации российских эмитентов и инвестиционные паи

Рисунок 18

Распределение СЧА ИПИФов по категориям фондов (млрд руб.)



* Отчетность предоставлена в соответствии с Указанием Банка России № 4715-У.

Источник: Банк России.

ПИФов (по 10,8%), потерявшие за квартал 3,7 и 2,1 процентного пункта.

2. КЛЮЧЕВЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ ПАЕВЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ И АКЦИОНЕРНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

Таблица 1

Основные показатели рынка паевых инвестиционных фондов и акционерных инвестиционных фондов

Наименование показателя	Единица измерения	30.06.2017	30.09.2017	31.12.2017	31.03.2018	30.06.2018*	Изменение за квартал
Количество ПИФов зарегистрированных, не исключенных из реестра паевых инвестиционных фондов	ед.	1 500	1 504	1 497	1 485	1 464	-1,4%
Закрытые ПИФы	ед.	1 132	1 136	1 131	1 117	1 109	-0,7%
Открытые ПИФы	ед.	332	331	327	325	312	-4,0%
Интервальные ПИФы	ед.	36	37	39	43	43	0,0%
Количество специализированных депозитариев, контролирурующих ПИФы (согласно сданной отчетности)	ед.	27	28	27	22	21	-4,5%
Количество управляющих компаний, осуществляющих ДУ ПИФов (согласно сданной отчетности)	ед.	286	279	278	273	261	-4,4%
Количество владельцев акций (паев) (согласно сданной отчетности)	тыс. ед.	1 473,0	1 486,7	1 516,4	1 555,8	1 610,1	3,5%
Закрытые ПИФы	тыс. ед.	10,1	10,9	10,8	9,3	9,4	1,2%
Открытые ПИФы	тыс. ед.	383,7	397,6	428,0	469,0	523,3	11,6%
Интервальные ПИФы	тыс. ед.	1 079,2	1 078,1	1 077,6	1 077,6	1 077,4	0,0%
Количество ПИФов для квалифицированных инвесторов, завершивших формирование (в том числе в стадии прекращения):	ед.	756	762	774	786	796	1,3%
Концентрация							
количество ПИФов, составляющих 80% активов	ед.	184	189	179	178	177	-0,6%
доля ПИФов, составляющих 80% активов	%	12,3	12,6	12,0	12,0	12,1	0,1 п.п.
количество УК, совместно контролирующих 80% активов	ед.	60	59	55	57	56	-1,8%
доля УК, совместно контролирующих 80% активов	%	21,0	21,1	19,8	20,9	21,5	0,58 п.п.
количество спецдепозитариев, совместно контролирующих 80% активов	ед.	5	5	5	5	5	0,0%
доля спецдепозитариев, совместно контролирующих 80% активов	%	18,5	17,9	18,5	22,7	23,8	1,08 п.п.
топ-20 ПИФов по СЧА	%	39,1	37,9	38,7	38,4	38,5	0,15 п.п.
топ-20 ПИФов по количеству участников – физических лиц	%	86,5	86,5	85,9	85,8	85,0	-0,75 п.п.
топ-20 УК по СЧА	%	54,6	54,4	55,3	54,4	55,9	1,56 п.п.
топ-100 ПИФов по СЧА	%	68,0	67,2	68,1	68,4	69,3	0,95 п.п.
топ-100 ПИФов по количеству участников – физических лиц	%	97,5	97,5	97,3	97,6	97,5	-0,13 п.п.
топ-100 УК по СЧА	%	90,3	90,6	91,1	91,2	91,9	0,75 п.п.
Активы	млн руб.	2 955 539,0	3 036 162,7	3 309 166,8	3 355 096,9	3 447 038,8	2,7%
Отношение активов к ВВП	%	3,3	3,4	3,6	3,6	3,6	-0,05 п.п.
Стоимость чистых активов (СЧА)	млн руб.	2 653 828,8	2 713 989,6	2 936 651,3	3 015 944,3	3 107 103,3	3,0%
СЧА ПИФов для квалифицированных инвесторов	млн руб.	2 019 242,3	2 079 102,4	2 247 539,7	2 290 465,4	2 348 217,0	2,5%
Обязательства по основному виду деятельности	млн руб.	301 710,3	322 173,1	372 515,4	339 152,5	339 935,6	0,2%
Количество действующих АИФов	шт.	3	3	3	2	2	0,0%
СЧА АИФов	млн руб.	4 245,2	4 335,0	3 478,6	1 515,3	1 436,2	-5,2%

Продолжение таблицы 1

Наименование показателя	Единица измерения	30.06.2017	30.09.2017	31.12.2017	31.03.2018	30.06.2018*	Изменение за квартал
Активы, в том числе:	млн руб.	2 955 539,0	3 036 162,7	3 309 166,8	3 355 096,9	3 447 038,8	2,7%
Денежные средства, в том числе:	млн руб.	190 945,7	228 954,4	259 542,1	291 603,5	317 974,0	9,0%
на текущих счетах	млн руб.	132 061,1	146 579,7	139 210,3	149 287,7	148 239,6	-0,7%
на депозитах	млн руб.	58 884,5	82 374,7	120 331,8	142 315,8	169 734,4	19,3%
Акции российских эмитентов (обыкновенные и привилегированные)	млн руб.	571 304,4	580 437,1	653 379,5	634 328,5	653 904,8	3,1%
Облигации российских эмитентов	млн руб.	105 184,7	121 150,5	156 634,4	189 229,3	223 696,2	18,2%
Государственные ценные бумаги	млн руб.	18 273,1	32 850,0	28 720,0	27 877,4	44 442,6	59,4%
Ценные бумаги субъектов Российской Федерации	млн руб.	3 680,9	3 839,0	8 980,5	8 952,1	10 016,8	11,9%
Муниципальные ценные бумаги	млн руб.	44,4	38,1	358,5	367,2	621,6	69,3%
Иностранные ценные бумаги	млн руб.	107 751,4	123 352,2	128 821,0	139 813,5	147 383,4	5,4%
Инвестиционные паи ПИФов	млн руб.	4 617,7	7 666,7	20 118,3	68 386,5	83 984,1	22,8%
Вклад в уставные (складочные) капиталы российских организаций	млн руб.	478 546,1	475 355,9	580 497,4	606 137,8	605 298,3	-0,1%
Векселя других организаций	млн руб.	28 922,8	27 652,8	29 691,8	31 188,9	30 269,9	-2,9%
Недвижимость, ипотечные ценные бумаги и залладные	млн руб.	1 046 011,7	1 015 056,6	961 580,1	948 309,0	920 553,4	-2,9%
недвижимость	млн руб.	1 045 657,3	1 014 754,9	941 097,3	934 802,3	760 285,6	-18,7%
ипотечные ценные бумаги и залладные	млн руб.	354,4	301,7	20 482,8	13 506,7	160 267,8	1086,6%
Прочие активы	млн руб.	400 256,2	419 809,3	480 843,1	408 903,0	408 893,9	0,0%
Стоимость чистых активов, в том числе:	млн руб.	2 653 828,8	2 713 989,6	2 936 651,3	3 015 944,3	3 107 103,3	3,0%
Закрытые ПИФы	млн руб.	2 471 407,5	2 503 398,4	2 698 568,8	2 734 402,8	2 778 177,0	1,6%
акций	млн руб.	80 400,5	77 308,9	33 919,8	33 645,2	32 719,7	-2,8%
денежного рынка	млн руб.	1 155,3	537,4	543,4	380,5	313,1	-17,7%
долгосрочных прямых инвестиций	млн руб.	586 709,0	568 928,7	243 078,3	249 332,1	198 645,5	-20,3%
ипотечный	млн руб.	1 040,9	594,2	33,0	33,6	33,9	0,9%
комбинированный	млн руб.	429 534,1	644 484,6	1 426 658,5	1 471 577,1	1 649 978,1	12,1%
кредитный	млн руб.	36 652,0	27 332,0	25 422,9	22 070,6	21 474,3	-2,7%
недвижимости	млн руб.	933 779,1	826 732,8	657 637,2	648 452,5	607 256,6	-6,4%
облигаций	млн руб.	1 534,3	1 512,7	X	X	X	X
особо рискованных (венчурных) инвестиций	млн руб.	26 304,9	26 706,0	19 659,2	19 074,5	16 166,3	-15,2%
прямых инвестиций	млн руб.	60 794,1	52 924,0	46 114,4	46 236,9	17 522,6	-62,1%
рентный	млн руб.	216 309,4	179 434,8	143 459,7	142 412,6	136 731,4	-4,0%
рыночных финансовых инструментов	млн руб.	X	X	X	X	533,7	X
смешанных инвестиций	млн руб.	84 763,9	84 820,8	88 654,9	87 012,6	85 616,1	-1,6%
товарного рынка	млн руб.	50,1	50,7	49,2	50,3	50,9	1,2%
финансовых инструментов	млн руб.	X	850,0	1 209,8	1 184,0	1 283,1	8,4%
хедж-фонд	млн руб.	12 379,8	11 180,6	12 128,4	12 940,5	9 851,7	-23,9%
художественных ценностей	млн руб.	X	X	X	X	X	X
Открытые ПИФы	млн руб.	162 800,7	190 523,0	217 828,3	259 294,7	303 714,7	17,1%
акций	млн руб.	33 523,0	28 833,2	X	X	X	X
денежного рынка	млн руб.	1 412,8	1 373,2	134,3	13,2	13,2	-0,3%
индексный	млн руб.	2 323,9	1 049,7	X	X	X	X
облигаций	млн руб.	102 627,7	76 871,8	X	X	X	X
рыночных финансовых инструментов	млн руб.	2 623,0	73 345,6	217 672,3	259 259,5	303 679,6	17,1%
смешанных инвестиций	млн руб.	9 561,8	4 294,8	21,7	22,0	21,9	-0,3%
фонд фондов	млн руб.	10 728,6	4 754,6	X	X	X	X

Продолжение таблицы 1

Наименование показателя	Единица измерения	30.06.2017	30.09.2017	31.12.2017	31.03.2018	30.06.2018*	Изменение за квартал
Интервальные ПИФы	млн руб.	19 620,5	20 068,2	20 254,2	22 246,8	25 211,6	13,3%
акций	млн руб.	1 932,2	417,6	426,6	448,6	378,2	-15,7%
комбинированный	млн руб.	X	8 926,1	9 251,9	10 882,4	13 712,8	26,0%
рыночных финансовых инструментов	млн руб.	73,3	4 505,9	4 818,6	5 034,0	5 051,9	0,4%
смешанных инвестиций	млн руб.	3 620,4	1 056,7	693,6	782,5	1 031,8	31,9%
товарного рынка	млн руб.	170,9	173,3	174,4	170,1	183,1	7,7%
фонд финансовых инструментов	млн руб.	X	X	15,0	23,4	104,2	344,7%
фонд фондов	млн руб.	16,7	10,6	7,7	7,0	0,0	-100,0%
хедж-фонд	млн руб.	13 806,9	4 977,9	4 866,4	4 898,9	4 749,5	-3,0%
Средневзвешенная доходность (изменение стоимости пая) с начала года**	%	-0,9	-2,2	7,5	3,5	6,4	7,24 п.п.
Закрытые ПИФы	%	-1,0	-2,7	7,3	3,5	6,6	7,59 п.п.
акций	%	1,0	-2,1	-2,8	-0,2	1,9	0,84 п.п.
денежного рынка	%	4,6	10,1	11,7	1,0	-16,9	-21,54 п.п.
долгосрочных прямых инвестиций	%	1,2	0,9	0,9	6,2	10,1	8,96 п.п.
ипотечный	%	-11,2	-10,7	3,7	1,9	2,8	14,01 п.п.
комбинированный	%	-1,4	-1,0	12,5	5,8	9,9	11,3 п.п.
кредитный	%	-9,0	-5,2	46,2	-8,0	-8,0	0,93 п.п.
недвижимости	%	0,0	-0,8	7,2	-0,3	0,5	0,5 п.п.
облигаций	%	5,3	3,8	X	X	X	X
особо рискованных (венчурных) инвестиций	%	-6,6	-11,0	-3,9	-1,8	-2,5	4,12 п.п.
прямых инвестиций	%	-0,6	-3,3	-3,9	0,3	1,4	2,06 п.п.
рентный	%	-7,0	-20,1	-15,6	1,0	1,5	8,49 п.п.
рыночных финансовых инструментов	%	X	X	X	X	-1,2	X
смешанных инвестиций	%	-4,2	-4,1	3,9	-1,8	-3,1	1,08 п.п.
товарного рынка	%	19,3	20,7	17,1	2,3	3,5	-15,73 п.п.
финансовых инструментов	%	X	X	X	-2,1	6,1	X
хедж-фонд	%	-4,3	-1,1	-15,3	7,0	14,8	19,11 п.п.
художественных ценностей	%	X	X	X	X	X	X
Открытые ПИФы	%	1,2	6,3	9,4	3,1	4,7	3,41 п.п.
акций	%	-5,2	6,5	X	X	X	X
денежного рынка	%	4,7	5,8	8,0	2,8	2,4	-2,26 п.п.
индексный	%	-14,0	-3,3	X	X	X	X
облигаций	%	5,0	6,6	X	X	X	X
рыночных финансовых инструментов	%	-4,0	5,9	9,4	3,1	4,7	8,66 п.п.
смешанных инвестиций	%	-0,7	3,9	5,2	1,1	0,8	1,57 п.п.
фонд фондов	%	4,0	11,1	X	X	X	X
Интервальные ПИФы	%	1,2	3,7	3,9	1,7	2,9	1,71 п.п.
акций	%	-5,5	12,3	11,9	4,5	2,4	7,92 п.п.
комбинированный	%	X	1,3	0,4	0,5	0,9	X
рыночных финансовых инструментов	%	8,5	2,1	3,1	4,6	5,5	-3,08 п.п.
смешанных инвестиций	%	-1,0	10,0	9,1	3,4	7,6	8,63 п.п.
товарного рынка	%	8,4	10,1	11,4	-0,4	3,7	-4,68 п.п.
фонд финансовых инструментов	%	X	X	X	-0,7	3,6	X
фонд фондов	%	4,2	-22,7	-42,7	3,6	-100,0	-104,15 п.п.
хедж-фонд	%	2,8	8,9	9,6	0,8	3,6	0,72 п.п.

Продолжение таблицы 1

Наименование показателя	Единица измерения	30.06.2017	30.09.2017	31.12.2017	31.03.2018	30.06.2018*	Изменение за квартал
Средневзвешенная доходность (изменение стоимости пая) за прошедший квартал	%	-3,1	-0,1	-1,2	3,5	2,5	-0,97 п.п.
Закрытые ПИФы	%	-3,4	-0,4	-1,5	3,6	2,7	-0,89 п.п.
акций	%	1,4	-3,1	-1,9	-0,2	0,8	1,06 п.п.
денежного рынка	%	2,0	5,1	1,1	1,0	-17,7	-18,68 п.п.
долгосрочных прямых инвестиций	%	1,5	2,9	1,4	6,2	2,0	-4,21 п.п.
ипотечный	%	-3,2	0,5	0,9	1,9	0,9	-1,03 п.п.
комбинированный	%	-15,2	2,5	0,5	5,8	4,1	-1,74 п.п.
кредитный	%	-3,9	-0,1	5,8	-8,0	1,4	9,37 п.п.
недвижимости	%	-1,1	-0,6	-6,7	-0,3	0,6	0,88 п.п.
облигаций	%	-1,4	-1,4	X	X	X	X
особо рискованных (венчурных) инвестиций	%	-6,2	-4,2	1,6	-1,8	-0,2	1,56 п.п.
прямых инвестиций	%	-0,2	-3,3	-1,5	0,3	0,6	0,38 п.п.
рентный	%	-0,9	-14,3	-5,0	1,0	-0,5	-1,56 п.п.
рыночных финансовых инструментов	%	X	X	X	X	-0,2	X
смешанных инвестиций	%	-4,4	0,1	4,0	-1,8	-1,3	0,44 п.п.
товарного рынка	%	9,4	1,2	-3,0	2,3	1,2	-1,02 п.п.
финансовых инструментов	%	X	X	0,5	-2,1	8,4	10,51 п.п.
хедж-фонд	%	3,3	3,1	-9,5	7,0	8,0	0,97 п.п.
художественных ценностей	%	X	X	X	X	X	X
Открытые ПИФы	%	1,6	4,6	1,8	3,1	1,5	-1,57 п.п.
акций	%	-2,8	11,4	X	X	X	X
денежного рынка	%	2,3	1,0	1,9	2,8	-0,3	-3,1 п.п.
индексный	%	-5,0	13,0	X	X	X	X
облигаций	%	3,2	1,8	1,8	X	X	X
рыночных финансовых инструментов	%	-0,3	4,3	X	3,1	1,5	-1,57 п.п.
смешанных инвестиций	%	0,0	8,0	1,6	1,1	-0,3	-1,38 п.п.
фонд фондов	%	6,4	2,8	X	X	X	X
Интервальные ПИФы	%	0,8	2,4	-0,2	1,7	-0,4	-2,11 п.п.
акций	%	-0,8	12,6	-0,7	4,5	-2,7	-7,22 п.п.
комбинированный	%	X	-0,2	-1,0	0,5	-2,3	-2,78 п.п.
рыночных финансовых инструментов	%	3,6	6,3	0,5	4,6	0,8	-3,82 п.п.
смешанных инвестиций	%	-0,1	4,8	0,7	3,4	3,3	-0,1 п.п.
товарного рынка	%	4,2	1,5	1,2	-0,4	4,1	4,51 п.п.
фонд финансовых инструментов	%	X	X	X	-0,7	4,3	4,99 п.п.
фонд фондов	%	-0,1	-25,8	-26,2	3,6	-100,0	-103,56 п.п.
хедж-фонд	%	1,3	2,8	0,3	0,8	2,8	1,98 п.п.
Выдача и погашение инвестиционных паев ПИФов с начала года**	млрд руб.	114,5	176,3	436,7	85,9	178,4	55,8%
Закрытые ПИФы	млрд руб.	83,7	125,1	362,9	48,1	97,1	16,1%
Объем выдачи ЗПИФов с начала года	млрд руб.	144,3	193,9	439,9	70,1	128,2	-11,1%
Объем погашения ЗПИФов с начала года	млрд руб.	60,6	68,8	77,0	22,0	31,2	-48,6%
Открытые ПИФы	млрд руб.	29,9	50,3	72,6	36,2	76,9	156,9%
Объем выдачи ОПИФов с начала года	млрд руб.	46,0	74,1	110,9	47,9	102,4	122,6%
Объем погашения ОПИФов с начала года	млрд руб.	16,1	23,8	38,3	11,6	25,5	58,6%

Окончание таблицы 1

Наименование показателя	Единица измерения	30.06.2017	30.09.2017	31.12.2017	31.03.2018	30.06.2018*	Изменение за квартал
Интервальные ПИФы	млрд руб.	0,9	0,9	1,2	1,6	4,4	373,8%
Объем выдачи ИПИФов с начала года	млрд руб.	1,1	1,2	1,5	1,6	5,2	356,6%
Объем погашения ИПИФов с начала года	млрд руб.	0,2	0,3	0,4	0,0	0,8	284,1%
Выдача и погашение инвестиционных паев ПИФов за квартал	млрд руб.	0,0	61,8	260,4	85,9	92,5	7,7%
Закрытые ПИФы	млрд руб.	-19,3	41,5	237,8	48,1	49,0	1,9%
Объем выдачи ЗПИФов за квартал	млрд руб.	30,3	49,7	246,0	70,1	58,2	-16,9%
Объем погашения ЗПИФов за квартал	млрд руб.	49,6	8,2	8,2	22,0	9,2	-58,2%
Открытые ПИФы	млрд руб.	18,5	20,3	22,3	36,2	40,7	12,3%
Объем выдачи ОПИФов за квартал	млрд руб.	26,5	28,1	36,8	47,9	54,5	13,9%
Объем погашения ОПИФов за квартал	млрд руб.	8,0	7,8	14,5	11,6	13,8	18,8%
Интервальные ПИФы	млрд руб.	0,9	0,0	0,3	1,6	2,8	78,3%
Объем выдачи ИПИФов за квартал	млрд руб.	1,0	0,0	0,3	1,6	3,6	124,6%
Объем погашения ИПИФов за квартал	млрд руб.	0,2	0,1	0,1	0,0	0,8	2176,5%

* Отчетность представлена в соответствии с Указанием Банка России №4715-У.

** Изменение за квартал – изменение по сравнению с аналогичным периодом предыдущего года.

Таблица 2

Изменение стоимости имущества паевых инвестиционных фондов (руб.)

Названия строк	Прирост «+» (уменьшение «-») стоимости имущества в результате сделок с имуществом - всего	Прирост «+» (уменьшение «-») стоимости имущества в результате изменения справедливой стоимости имущества - всего	Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд), - всего	Оплата по договорам, в том числе по договорам аренды, права из которых составляют имущество фонда	Сумма начисленных в том числе по договорам аренды, права из которых составляют имущество фонда	Сумма начисленных расходов, связанных с управлением акционерным инвестиционным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом	Сумма начисленных дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда)
Закрывающий	9 332 735 739,52	24 374 970 147,15	26 521 873 103,80	448 953 928,25	3 415 821 681,75	6 627 384 050,62	15 819 196 932,02
Акции	59 511 415,74	-69 896 476,59	92 706 569,48	-	34 983 381,11	1 985 906,59	5 001 777,09
Денежного рынка	-	-	5 241 565,17	-	397 800,00	7 048,65	-
Долгосрочных прямых инвестиций	429 731 101,51	1 498 255 095,94	847 340 767,27	-	268 790 059,02	3 741 792,47	268 025 363,00
Ипотечный	-	-136,99	635 819,99	-	187 765,95	2 856,68	-
Комбинированный	5 653 200 650,44	29 424 478 804,98	12 364 231 587,68	109 544 583,03	1 681 937 250,32	1 994 047 055,36	6 868 481 633,71
Кредитный	-493 211 555,63	-138 746 464,04	450 891 985,49	-	60 264 046,14	6 476 053,64	118 825 615,49
Недвижимости	3 514 003 671,77	-3 579 774 591,33	10 038 783 468,11	336 793 189,14	1 042 613 872,42	4 362 074 496,77	6 345 622 011,58
Особо рискованных (венчурных) инвестиций	-38 289 369,96	-217 170 992,27	916 442 458,68	-	84 630 880,58	535 944,34	841 744 400,07
Прямых инвестиций	151 126 032,57	-189 250 073,18	894 213 888,51	-	18 491 764,94	48 985,52	755 564 144,53
Рентный	-38 611 056,16	-1 557 525 901,43	520 425 178,05	2 616 156,08	117 735 007,37	256 716 636,60	615 900 826,80
Рыночных финансовых инструментов	-	-	-	-	554 225,72	213 758,00	-
Смешанных инвестиций	35 010 847,15	-1 610 424 357,15	364 034 482,97	-	92 840 275,86	1 461 814,48	31 159,75
Товарного рынка	-742 657,46	2 007 252,42	-	-	657 417,87	-	-
Фонд финансовых инструментов	-1 107 406,71	90 412 352,27	15 595 633,94	-	6 455 866,75	33 643,67	-
Хедж-фонд	62 114 066,26	722 605 634,52	11 329 698,46	-	5 282 067,70	38 057,85	-
Интервальный	-61 703 915,80	458 448 467,12	301 896 845,42	-	95 117 700,29	8 406 556,92	-
Акции	346 526,30	-15 250 452,63	7 131 841,02	-	2 658 993,36	39 062,12	-
Комбинированный	-66 403 862,71	124 029 018,04	99 856 407,05	-	29 526 102,75	5 516 015,03	-
Рыночных финансовых инструментов	-17 247 825,44	13 335 854,56	97 344 995,71	-	48 160 686,86	780 174,41	-
Смешанных инвестиций	1 272 848,43	13 086 725,22	20 700 485,34	-	5 173 204,65	563 204,01	-
Товарного рынка	-	7 557 934,13	-	-	503 114,50	-	-
Фонд финансовых инструментов	-27 181,45	1 384 034,91	23 346,33	-	347 639,06	127 157,07	-
Фонд фондов	-	-6 942 210,30	-	-	39 570,39	60,00	-
Хедж-фонд	20 355 579,07	321 247 563,19	76 839 769,97	-	8 708 388,72	1 380 884,28	-
Открывающий	-105 842 962,57	716 791 750,58	4 820 028 724,90	-	1 408 885 635,85	44 391 533,27	-
Денежного рынка	1 793,81	-43 705,00	18 208,00	-	65 705,83	3 249,09	-
Рыночных финансовых инструментов	-105 844 806,38	716 835 455,58	4 820 010 516,90	-	1 408 781 692,89	44 383 809,43	-
Смешанных инвестиций	50,00	-	-	-	38 237,13	4 474,75	-

Таблица 3

Активы паевых инвестиционных фондов (млн руб.)

Наименование показателя	II кв. 2017	III кв. 2017	IV кв. 2017	I кв. 2018	II кв. 2018
Активы ПИФов, в том числе:	2 955 539,01	3 036 162,71	3 309 166,76	3 355 096,87	3 447 038,85
Денежные средства, в том числе:	190 945,67	228 954,42	259 542,11	291 603,49	317 973,97
на текущих счетах	132 061,13	146 579,74	139 210,32	149 287,74	148 239,57
на депозитах	58 884,54	82 374,68	120 331,79	142 315,75	169 734,40
Акции российских эмитентов (обыкновенные и привилегированные)	571 304,40	580 437,08	653 379,46	634 328,54	653 904,76
Облигации российских эмитентов	105 184,69	121 150,49	156 634,40	189 229,32	223 696,20
Государственные ценные бумаги	18 273,06	32 850,03	28 719,96	27 877,42	44 442,60
Ценные бумаги субъектов РФ	3 680,85	3 839,00	8 980,52	8 952,12	10 016,81
Муниципальные ценные бумаги	44,43	38,12	358,51	367,21	621,58
Иностранные ценные бумаги	107 751,43	123 352,24	128 821,01	139 813,54	147 383,39
Инвестиционные паи ПИФов	4 617,74	7 666,68	20 118,33	68 386,49	83 984,06
Вклад в уставные (складочные) капиталы россий- ских организаций	478 546,07	475 355,92	580 497,41	606 137,82	605 298,35
Векселя других организаций	28 922,76	27 652,82	29 691,79	31 188,89	30 269,87
Недвижимость, ипотечные ценные бумаги и закладные, в том числе:	1 046 011,67	1 015 056,63	961 580,14	948 308,99	920 553,36
недвижимость	1 045 657,30	1 014 754,88	941 097,35	934 802,28	760 285,56
ипотечные ценные бумаги и закладные	354,37	301,75	20 482,79	13 506,71	160 267,80
Прочие активы	400 256,24	419 809,28	480 843,12	408 903,03	408 893,89
Активы ЗПИФов, в том числе:	2 770 650,01	2 822 772,71	3 068 027,40	3 070 161,90	3 107 316,21
Денежные средства, в том числе:	182 679,29	222 314,52	254 793,06	283 024,97	313 212,81
на текущих счетах	128 340,10	140 791,17	134 992,14	140 860,64	143 586,29
на депозитах	54 339,19	81 523,35	119 800,92	142 164,32	169 626,52
Акции российских эмитентов (обыкновенные и привилегированные)	535 201,63	541 281,05	614 487,33	593 218,29	609 745,07
Облигации российских эмитентов	34 536,53	42 831,73	51 289,10	51 286,81	60 029,13
Государственные ценные бумаги	944,27	2 289,05	2 950,10	2 289,82	3 823,13
Ценные бумаги субъектов РФ	35,78	21,06	36,29	32,93	24,10
Муниципальные ценные бумаги	-	-	-	-	-
Иностранные ценные бумаги	65 636,83	82 021,71	83 197,16	86 962,87	84 209,99
Инвестиционные паи ПИФов	4 568,72	4 021,18	17 122,72	65 389,26	80 565,21
Вклад в уставные (складочные) капиталы российских организаций	478 546,07	475 355,92	580 497,41	606 137,82	605 298,34
Векселя других организаций	28 922,76	27 652,82	29 691,79	31 188,89	30 269,87
Недвижимость, ипотечные ценные бумаги и закладные, в том числе:	1 046 011,67	1 015 056,63	959 789,62	947 999,63	920 222,23
недвижимость	1 045 657,30	1 014 754,88	939 412,87	934 802,28	759 954,44
ипотечные ценные бумаги и закладные	354,37	301,75	20 376,74	13 197,34	160 267,80
Прочие активы	393 566,46	409 927,03	474 172,81	402 630,61	399 916,32
Активы ИПИФов, в том числе:	19 986,86	20 344,27	20 780,19	23 242,02	31 682,33
Денежные средства, в том числе:	3 713,73	206,61	221,82	1 336,91	351,49
на текущих счетах	269,40	62,00	127,75	1 280,68	348,82
на депозитах	3 444,33	144,61	94,06	56,24	2,67
Акции российских эмитентов (обыкновенные и привилегированные)	7 927,44	7 955,39	8 059,55	8 270,39	8 459,77
Облигации российских эмитентов	2 489,89	2 573,36	3 241,93	3 358,46	3 420,55
Государственные ценные бумаги	397,43	352,95	386,44	351,61	5 927,07
Ценные бумаги субъектов РФ	36,33	55,08	93,07	75,16	64,90
Муниципальные ценные бумаги	2,39	-	-	-	-
Иностранные ценные бумаги	4 166,73	4 461,48	4 908,35	5 906,27	8 634,09
Инвестиционные паи ПИФов	-	3 601,85	2 975,58	2 990,94	3 412,60

Окончание таблицы 3

Наименование показателя	II кв. 2017	III кв. 2017	IV кв. 2017	I кв. 2018	II кв. 2018
Вклад в уставные (складочные) капиталы российских организаций	-	-	-	-	0,01
Векселя других организаций	-	-	-	-	-
Недвижимость, ипотечные ценные бумаги и закладные, в том числе:	-	-	-	-	-
недвижимость	-	-	-	-	-
ипотечные ценные бумаги и закладные	-	-	-	-	-
Прочие активы	1 252,92	1 137,55	893,45	952,27	1 411,86
Активы ОПИФов, в том числе:	164 902,14	193 045,73	220 359,18	261 692,95	308 040,31
Денежные средства, в том числе:	4 552,65	6 433,29	4 527,24	7 241,61	4 409,67
на текущих счетах	3 451,63	5 726,57	4 090,43	7 146,42	4 304,46
на депозитах	1 101,02	706,72	436,80	95,19	105,21
Акции российских эмитентов (обыкновенные и привилегированные)	28 175,34	31 200,65	30 832,57	32 839,85	35 699,92
Облигации российских эмитентов	68 158,27	75 745,40	102 103,36	134 584,05	160 246,52
Государственные ценные бумаги	16 931,36	30 208,02	25 383,42	25 235,99	34 692,39
Ценные бумаги субъектов РФ	3 608,74	3 762,85	8 851,16	8 844,02	9 927,81
Муниципальные ценные бумаги	42,04	38,12	358,51	367,21	621,58
Иностранные ценные бумаги	37 947,88	36 869,06	40 715,50	46 944,40	54 539,32
Инвестиционные паи ПИФов	49,01	43,64	20,03	6,29	6,26
Вклад в уставные (складочные) капиталы российских организаций	-	-	-	-	-
Векселя других организаций	-	-	-	-	-
Недвижимость, ипотечные ценные бумаги и закладные, в том числе:	-	-	1 790,52	309,37	331,12
недвижимость	-	-	1 684,47	-	331,12
ипотечные ценные бумаги и закладные	-	-	106,05	309,37	-
Прочие активы	5 436,86	8 744,70	5 776,86	5 320,15	7 565,71

3. МЕТОДИЧЕСКИЕ ПОЯСНЕНИЯ К КЛЮЧЕВЫМ ПОКАЗАТЕЛЯМ ПАЕВЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ И АКЦИОНЕРНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

Общие положения

В таблице 1 раздела 2 представлены показатели, характеризующие деятельность акционерных инвестиционных фондов (АИФ) и паевых инвестиционных фондов (ПИФ), с разбивкой по типам и категориям ПИФов: количество ПИФов и АИФов, количество управляющих компаний и специализированных депозитариев, количество владельцев паев ПИФов, активы ПИФов (в том числе с разбивкой по видам активов), стоимость чистых активов ПИФов (в том числе с разбивкой по типам и категориям ПИФов), стоимость чистых активов АИФов, общая величина обязательств, средневзвешенная доходность ПИФов с разбивкой по типам и категориям ПИФов с начала года и за квартал, выдача и погашение инвестиционных паев ПИФов за период с начала года и за квартал с разбивкой по типам ПИФов. В таблице 2 раздела 2 приведены сведения о приросте/уменьшении стоимости имущества, составляющего паевой инвестиционный фонд, в разбивке по типам и категориям. В таблице 3 раздела 2 представлены данные по видам активов ПИФов в целом и по отдельным типам.

Показатели в перечисленных выше таблицах формируются на основе агрегированных данных в соответствии с Указанием Банка России от 24.03.2017 №4323-У «О формах, порядке и сроках составления и представления в Банк России отчетов акционерными инвестиционными фондами, управляющими компаниями инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов», а также в соответствии с Указа-

нием Банка России от 8.02.2018 №4715-У «О формах, порядке и сроках составления и представления в Банк России отчетов акционерными инвестиционными фондами, управляющими компаниями инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов» за соответствующие периоды.

Характеристика отдельных показателей

Количество ПИФов зарегистрированных, не исключенных из реестра паевых инвестиционных фондов, – количество всех ПИФов, прошедших регистрацию, в том числе ПИФов, находящихся на стадии прекращения.

Стоимость чистых активов ПИФов (АИФов) определяется как разность между стоимостью активов ПИФов (АИФов) и величиной обязательств, подлежащих исполнению за счет указанных активов.

Обязательства по основному виду деятельности для ПИФов представляют собой сумму кредиторской задолженности, резерв на выплату вознаграждения управляющей компании, специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже.

Средневзвешенная по стоимости чистых активов доходность всех ПИФов, а также отдельных типов и категорий ПИФов рассчитывается как средневзвешенное по стоимости чистых активов изменение расчетной стоимости пая за период с начала года и за квартал. Доходность отдельных ПИФов, приведенная в тексте, представля-

ет собой изменение расчетной стоимости пая за рассматриваемый период. Перерасчет данных таблицы 1 в проценты годовых осуществляется посредством возведения средневзвешенной доходности за квартал в четвертую степень.

Выдача и погашение инвестиционных паев ПИФов представляют собой сумму показателей выдачи инвестиционных паев ПИФов и сумму показателей погашения инвестиционных паев ПИФов. Изменение

стоимости имущества ПИФов за квартал формируется посредством суммирования изменений стоимости имущества за три месяца отчетного периода в соответствии с формой ОКУД 0420503. Изменение стоимости имущества ПИФов может не совпадать с приростом СЧА между двумя отчетными датами, так как СЧА фиксируется в обзоре по состоянию на отчетную дату в соответствии с формой ОКУД 0420502.

