



Банк России

Центральный банк Российской Федерации



**II квартал
2017**

Информационно-
аналитические
материалы

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

Москва

Настоящий обзор подготовлен Департаментом развития финансовых рынков 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.

Содержание

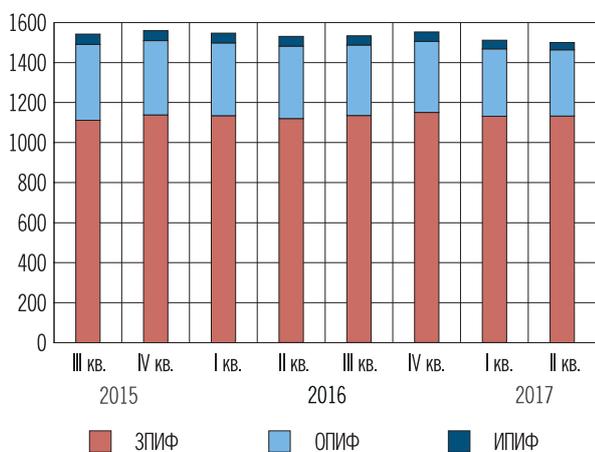
1. ПАЕВЫЕ ИНВЕСТИЦИОННЫЕ ФОНДЫ	2
2. АКЦИОНЕРНЫЕ ИНВЕСТИЦИОННЫЕ ФОНДЫ	11
3. КЛЮЧЕВЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ ПАЕВЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ И АКЦИОНЕРНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ	13
4. МЕТОДИЧЕСКИЕ ПОЯСНЕНИЯ К КЛЮЧЕВЫМ ПОКАЗАТЕЛЯМ ПАЕВЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ И АКЦИОНЕРНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ	21

1. ПАЕВЫЕ ИНВЕСТИЦИОННЫЕ ФОНДЫ¹

В II квартале 2017 года основными событиями на рынке паевых инвестиционных фондов стали изменение структуры активов ПИФов и увеличение количества фондов новых категорий. Так, в отличие от I квартала текущего года, когда объем акций в активах фондов вырос почти на 200 млрд рублей, в II квартале он сократился на 59,2 млрд рублей, а доля этих бумаг в структуре активов фондов снизилась с 20,8 до 19,3%. Уменьшение объема акций проходило на фоне снижения их рыночной стоимости. За I квартал значение индекса ММВБ (MICEXINDEXCF) сократилось на 36,1% в годовом выражении, за II квартал 2017 года – на 21,4% в годовом выражении. Кроме того, на рынке продолжается процесс смены фондами категорий, начавшийся в I квартале. Количество комбинированных ЗПИФов выросло до 119 на конец июня 2017 года (в предыдущем квартале – 46), в том числе за счет смены 42 фондами своей категории. Второй квартал подряд наибольшее количество фондов, ставших комбинированными, относились к категории недвижимости: 22 – в II квартале, 34 – с начала года. Стоимость чистых активов (СЧА) комбинированных фондов за период с конца марта по конец июня увеличилась почти в 3 раза, до 429,5 млрд рублей. Помимо этого, на рынке появились первые розничные фонды рыночных финансовых инструментов: 12 ОПИФов и один ИПИФ сменили категории, также были зарегистрированы три ОПИФа новой категории. На конец II квартала 2017 года СЧА фондов рыночных финансовых инструментов составляла почти 2,7 млрд рублей. Вместе с тем к концу июня 2017 года объем активов ПИФов опустился ниже 3 трлн рублей, а отношение этих средств к ВВП за предыдущие 12 месяцев составило 3,3%.

¹ Обзор подготовлен на основе данных отчетности, предоставленной управляющими компаниями 1372 ПИФов и трех АИФов по состоянию на 19.07.2017.

Рисунок 1.1
Количество зарегистрированных ПИФов, по типам (единиц)



Источник: Банк России.

В II квартале 2017 года количество зарегистрированных ПИФов² уменьшилось на 12, до 1500. Негативное влияние на динамику оказали открытые (-6) и интервальные (-7) ПИФы. Число ЗПИФов за квартал увеличилось на один фонд. Количество фондов для квалифицированных инвесторов сократилось до 756 (-7).

Вместе с тем концентрация на рынке снизилась. Доля ПИФов, входящих в топ-20 по СЧА, сократилась с 41,5 до 39,1%, а входящих в топ-100, – с 69,1 до 68%.

Количество компаний, управляющих ПИФами (УК), также уменьшилось. На конец июня на рынке работали 286 УК (-6 за квартал).

По итогам квартала объем активов фондов снова опустился ниже 3 трлн рублей. С начала апреля по конец июня 2017 года активы ПИФов уменьшились на 2,6%, до 2955,5 млрд рублей. Отношение этих средств к ВВП за последние 12 месяцев составило 3,3% (в предыдущем квартале – 3,5%).

² Зарегистрированные ПИФы включают в себя фонды:

- не начавшие формирование;
- находящиеся в стадии формирования;
- завершившие формирование;
- имеющие истекший срок действия договора ДУ;
- находящиеся в стадии прекращения.

Рисунок 1.2
Количество управляющих компаний, осуществляющих доверительное управление ПИФами



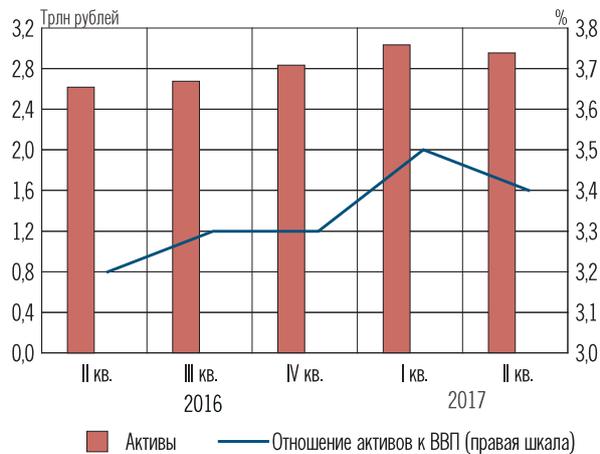
Источник: Банк России.

В II квартале 2017 года СЧА ПИФов снизилась на 2,7% (-74,9 млрд рублей в абсолютном выражении), до 2653,8 млрд рублей. Наибольший вклад в сокращение СЧА внесла выплата дохода по инвестиционным паям ПИФов³, которая по итогам квартала составила почти 63,5 млрд рублей. Кроме того, на 31,2 млрд рублей уменьшилась оценочная стоимость имущества⁴. Наибольшее положительное влияние на динамику СЧА оказал доход по имуществу, составляющему паевой инвестиционный фонд⁵, – 27,8 млрд рублей. При этом нетто-приток инвестиций не превысил 49,6 млн рублей, что объясняется существенным оттоком

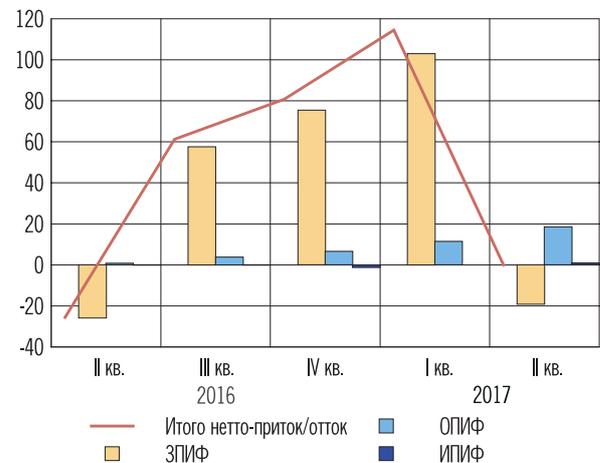
³ Выплата дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда) по данным формы 0420503 Указания Банка России от 16.12.2015 № 3901-У «О сроках и порядке составления и представления в Банк России отчетности акционерного инвестиционного фонда и отчетности управляющей компании инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов» (зарегистрированов Минюсте России 28.01.2016 № 40887).

⁴ Прирост/уменьшение стоимости имущества в результате изменения оценочной стоимости имущества по данным формы 0420503 Указания Банка России от 16.12.2015 № 3901-У.

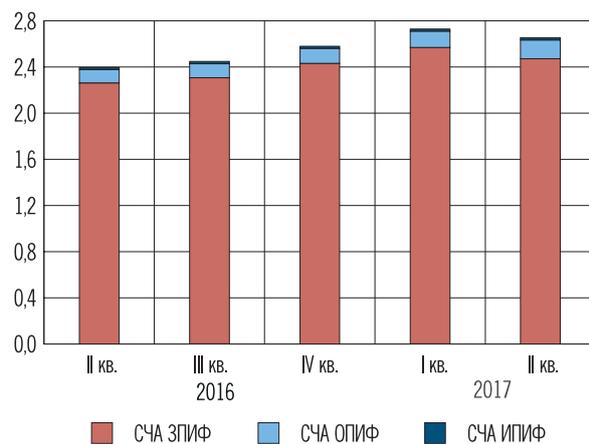
⁵ Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд), по данным формы 0420503 Указания Банка России от 16.12.2015 № 3901-У.

Рисунок 1.3
Динамика активов ПИФов

Источник: Банк России.

Рисунок 1.5
Чистая выдача/погашение инвестиционных паев
(млрд рублей)

Источник: Банк России.

Рисунок 1.4
Стоимость чистых активов по типам ПИФов
(трлн рублей)

Источник: Банк России.

средств в результате погашения инвестиционных паев ЗПИФов (более 49,6 млрд рублей).

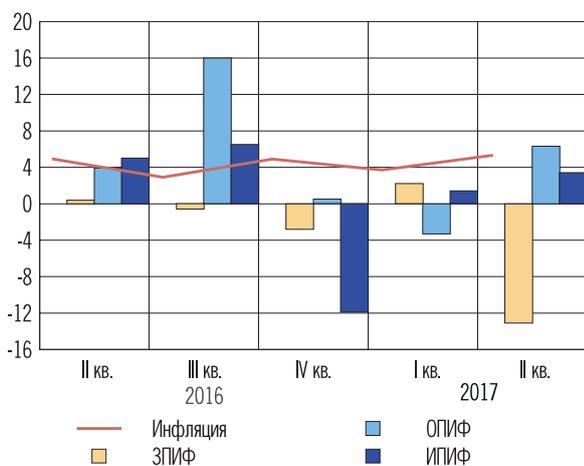
За прошедший квартал количество владельцев паев ЗПИФов уменьшилось на 0,3%, до 10,1 тысяч. Отток держателей паев наблюдался и в ИПИФах: -0,04% за квартал (до 1079,2 тыс.). Вместе с тем число владельцев паев ОПИФов выросло на 1,5%, до 383,7 тыс., что привело к увеличению совокупного количества держателей паев почти на 0,3% (5,1 тыс. в абсолютном значении), до 1473 тысяч.

Средневзвешенная доходность ПИФов в II квартале 2017 года составила -12% годовых при инфляции в 5,4% годовых. В то же время средневзвешенная доходность ЗПИФов – крупнейшего сектора по СЧА на рынке – упала до -13,1% годовых. ОПИФы и ИПИФы за прошедший квартал показали положительную доходность – 6,3 и 3,4% годовых соответственно.

На рынке продолжается процесс смены фондами категорий, начавшийся в I квартале 2017 года. С апреля по июнь 42 существующих ЗПИФа⁶ изменили свою категорию и стали комбинированными. В II квартале, так же как и в первом, наибольшее количество фондов, сменивших категорию, относилось к фондам недвижимости: 22 и 12 фондов соответственно. Вместе с тем были зарегистрированы правила доверительного управления 33 вновь созданными комбинированными ЗПИФа. По итогам II квартала 2017 года СЧА комбинированных ЗПИФов превысила 429,5 млрд рублей.

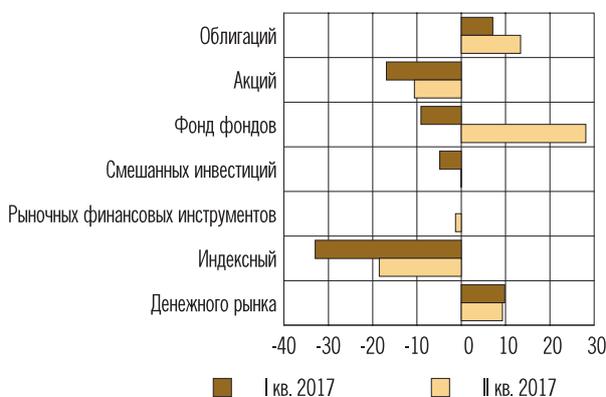
⁶ По данным реестра паевых инвестиционных фондов, 22 фонда недвижимости, 8 фондов долгосрочных прямых инвестиций, 3 фонда прямых инвестиций, 3 рентных фонда, 2 кредитных фонда, 2 фонда акций и 2 хедж-фонда (http://cbr.ru/finmarket/supervision/sv_coll/).

Рисунок 1.6
Динамика квартальной доходности ПИФов и инфляции
(% годовых)



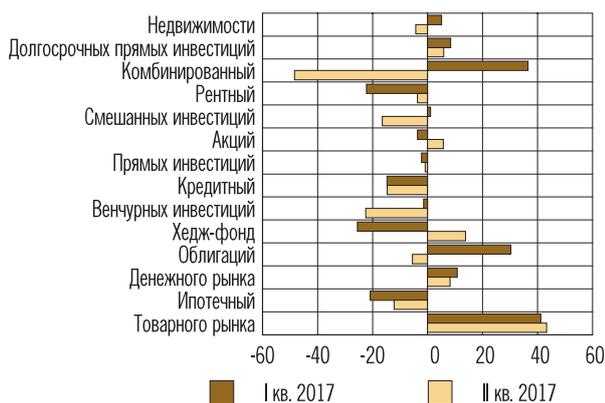
Источник: Банк России.

Рисунок 1.8
Доходность ОПИФов (% годовых)*



* Категории фондов указаны по убыванию доли СЧА в совокупной СЧА ОПИФов на 30.06.2017.
Источник: Банк России.

Рисунок 1.7
Доходность ЗПИФов (% годовых)*



* Категории фондов указаны по убыванию доли СЧА в совокупной СЧА ЗПИФов на 30.06.2017.
Источник: Банк России.

Рисунок 1.9
Доходность ИПИФов (% годовых)*



* Категории фондов указаны по убыванию доли СЧА в совокупной СЧА ИПИФов на 30.06.2017.
Источник: Банк России.

Помимо этого, на рынке появились первые ОПИФы рыночных финансовых инструментов: три вновь созданных фонда и 12 фондов, сменивших категорию⁷. Один ИПИФ⁸ в результате смены категории также стал фондом рыночных финансовых инструментов. СЧА ОПИФов новой категории

на конец июня достигла 2,6 млрд рублей, СЧА ИПИФа – 73,3 млн рублей.

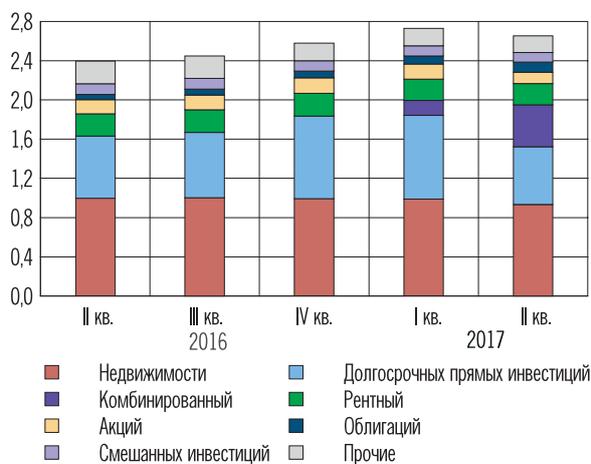
Согласно Указанию Банка России⁹, все ОПИФы должны быть приведены в соответствие с новыми требованиями в течение одного года с момента вступления документа в силу, ИПИФы – в течение трех лет, ЗПИФы – 10 лет. Вновь создаваемые фон-

⁷ По данным реестра паевых инвестиционных фондов, 5 фондов акций, 2 фонда облигаций, 3 фонда смешанных инвестиций и 2 фонда фондов (http://cbr.ru/finmarket/supervision/sv_coll/).

⁸ По данным реестра паевых инвестиционных фондов, фонд товарного рынка (http://cbr.ru/finmarket/supervision/sv_coll/).

⁹ Указание Банка России от 05.09.2016 №4129-У «О составе и структуре активов акционерных инвестиционных фондов и активов паевых инвестиционных фондов» вступило в силу по истечении 30 дней после дня его официального опубликования; опубликовано 17.11.2016 (<http://www.cbr.ru/analytics/Default.aspx?PrID=navr&docid=157>).

Рисунок 1.10
Стоимость чистых активов по категориям ПИФов
(трлн рублей)

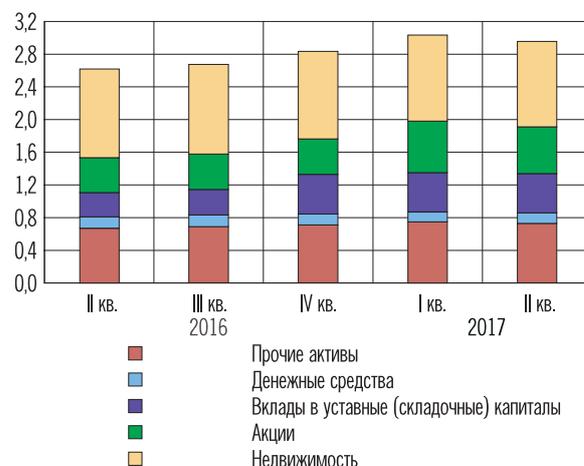


Источник: Банк России.

ды для квалифицированных инвесторов могут относиться к категории фондов финансовых инструментов, недвижимости и комбинированных фондов, для неквалифицированных инвесторов – к категории рыночных финансовых инструментов и недвижимости.

В II квартале наиболее существенным изменением в структуре активов ПИФов стало сокращение объема акций. За период с апреля по июнь объем этого инструмента в активах ПИФов сократился на 59,2 млрд рублей в абсолютном выражении, до 571,3 млрд рублей, а доля акций в структуре активов – на 1,5 п.п., до 19,3%. Снижение вложений в акции обеспечили закрытые фонды: за квартал объем этого инструмента в их активах уменьшился на 57,7 млрд рублей. Кроме того, за счет ЗПИФов фонды на 38,5 млрд рублей сократили вложения в векселя. В результате доля векселей в совокупном объеме активов ПИФов снизилась с 2,2 до 1%. На 8,5 млрд рублей сократились вложения в недвижимость, однако это по-прежнему основной объект инвестирования – 35,4% в структуре активов (+0,6 п.п. за квартал). При этом наибольшее увеличение активов было отмечено в категории «иностранные ценные бумаги» (+15,1 млрд рублей, из них

Рисунок 1.11
Структура активов ПИФов (трлн рублей)



Источник: Банк России.

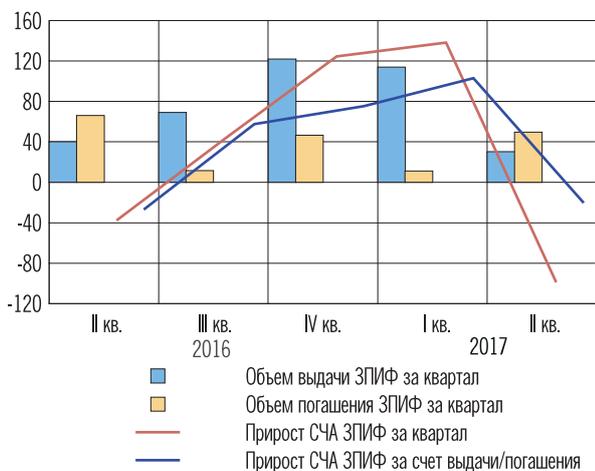
10,2 млрд рублей – в активах закрытых фондов), а их доля выросла с 3,1 до 3,6%. На 11,3 млрд рублей увеличился объем средств на текущих счетах (4,5% в структуре активов) и на 9,9 млрд рублей – объем корпоративных облигаций (3,6%). Причем вложения в последний инструмент выросли за счет ОПИФов на 16,1 млрд рублей, в то время как в ЗПИФах объем облигаций уменьшился на 3,4 млрд рублей, а в ИПИФах – на 2,7 млрд рублей.

Закрытые паевые инвестиционные фонды

В II квартале количество ЗПИФов на рынке увеличилось на один фонд и на конец июня составило 1132.

Доля этого сектора по объему СЧА на рынке ПИФов за квартал сократилась на 1 п.п., до 93,1%, а СЧА снизилась до 2,5 трлн рублей (-97,7 млрд рублей). Нетто-отток инвестиций достиг 19,3 млрд рублей при объеме выдачи паев лишь 30,3 млрд рублей. До этого нетто-отток инвестиций (-26 млрд рублей) наблюдался в II квартале 2016 года, а по объему выдачи паев результат прошедшего квартала оказался наименьшим за последние три года. Негативное влияние на СЧА

Рисунок 1.12
Динамика СЧА, объемов выдачи и погашения
инвестиционных паев ЗПИФов (млрд руб.)



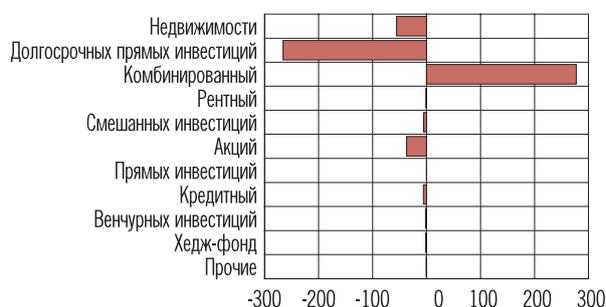
Источник: Банк России.

ЗПИФов также оказали значительная выплата дохода по инвестиционным паям ЗПИФов (63,5 млрд рублей) и уменьшение стоимости имущества фондов в результате изменения оценочной стоимости имущества – 32,9 млрд рублей. Наибольший положительный вклад в динамику СЧА ЗПИФов внес доход по имуществу, составляющему ПИФы, который достиг почти 24,9 млрд рублей.

Максимальное увеличение СЧА было зафиксировано в комбинированных фондах (+277,3 млрд рублей), но рост в основном обеспечили фонды, сменившие категорию. При этом СЧА ЗПИФов долгосрочных прямых инвестиций сократилась на 265,5 млрд рублей, фондов недвижимости – на 55,5 млрд рублей, фондов акций – на 37,1 млрд рублей. Абсолютное изменение СЧА остальных категорий закрытых фондов находилось в пределах 7 млрд рублей, совокупное сокращение оставшихся категорий – почти 17 млрд рублей.

На фоне сокращения СЧА ЗПИФов недвижимости до 933,8 млрд рублей доля этой категории фондов – крупнейшей в структуре ЗПИФов – уменьшилась с 38,5 до 37,8%. При этом 22 ЗПИФа недвижимости сменили категорию и стали комбинированными фондами.

Рисунок 1.13
Динамика СЧА отдельных категорий ЗПИФов
в II квартале 2017 года (млрд руб.)*



* Категории фондов указаны по убыванию доли СЧА в совокупной СЧА ЗПИФов на 30.06.2017. К «прочим» отнесены категории ЗПИФов, доля СЧА каждой из которых в структуре СЧА ЗПИФов – менее 0,1%. Комбинированные фонды, СЧА которых была сформирована в первую очередь за счет смены рядом фондом своих категорий, не отражены на графике.
Источник: Банк России.

На 9,4 п.п., до 23,7%, сократилась доля СЧА ЗПИФов долгосрочных прямых инвестиций – вторых по объему СЧА в структуре закрытых фондов. На конец июня СЧА этой категории фондов достигала 586,7 млрд рублей, что на треть меньше, чем в предыдущем квартале. Сокращение СЧА этой категории фондов вызвано в том числе переходом восьми ЗПИФов в категорию комбинированных.

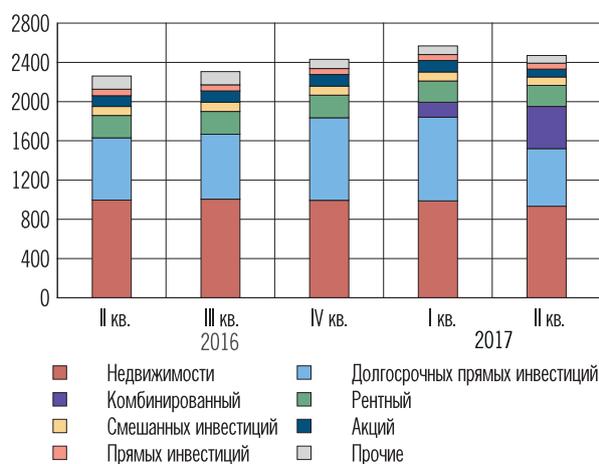
За счет почти трехкратного роста СЧА комбинированных фондов до 429,5 млрд рублей ЗПИФы этой категории стали третьими по величине СЧА в структуре закрытых фондов, а их доля выросла на 11,5 п.п., до 17,4%. Таким образом, эти фонды стали третьими по СЧА в структуре закрытых фондов.

Открытые паевые инвестиционные фонды

В II квартале 2017 года количество ОПИФов уменьшилось на 6, до 332.

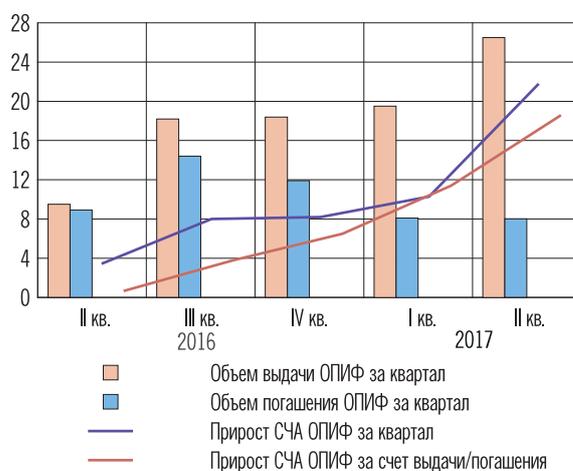
При этом СЧА этого типа фондов выросла на 15,4%, до 162,8 млрд рублей, а доля этих фондов в структуре рынка – почти на 1 п.п., до 6,1%. Прирост СЧА ОПИФов (21,7 млрд рублей) в основном обеспечил нетто-приток инвестиций (18,5 млрд

Рисунок 1.14
Распределение СЧА ЗПИФов по категориям фондов
(млрд руб.)



Источник: Банк России.

Рисунок 1.15
Динамика СЧА, объемов выдачи и погашения
инвестиционных паев ОПИФов (млрд руб.)



Источник: Банк России.

рублей). Кроме того, доход по имуществу, составляющему паевой инвестиционный фонд, достиг 2,7 млрд рублей, еще на 1,5 млрд рублей увеличилась стоимость имущества в результате изменения его оценочной стоимости. Вместе с тем около 1 млрд рублей фонды потратили на оплату вознаграждений управляющей компании, специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации.

Как и в предыдущем квартале, существенный рост СЧА ОПИФов обеспечили фонды облигаций: +22,4 млрд рублей. По остальным категориям фондов было зафиксировано сокращение СЧА: от 118,1 млн рублей (индексные ОПИФы) до 2 млрд рублей (фонды акций). Вместе с тем на рынке были зарегистрированы ОПИФы рыночных финансовых инструментов, СЧА которых на конец июня составила 2,6 млрд рублей.

Прирост СЧА ОПИФов облигаций, в результате которого доля этой категории фондов в секторе ОПИФов выросла на 6,2 п.п., до 63%, связан с нетто-притоком инвестиций. Объем выдачи паев достиг 23,7 млрд рублей при объеме погашений 4,4 млрд рублей. Приток новых инвестиций в ОПИФы облигаций объясняется в том числе

ростом рынка облигаций на фоне снижения ставок по депозитам. Так, за I квартал 2017 года прирост индекса корпоративных облигаций ММВБ (MICEXCBITR) составил 13,1% годовых¹⁰, а с апреля 2016 по март 2017 года – 10,7%. При этом в период с января по март 2017 года средневзвешенная ставка по депозитам сократилась с 7,83 до 7,17% годовых¹¹ на фоне снижения ключевой ставки в марте с 10 до 9,75%¹². В мае, вслед за вторым снижением ключевой ставки (до 9,25%) с начала года, средневзвешенная процентная ставка по депозитам уменьшилась до 6,98% годовых.

Вместе с тем смена двумя ОПИФами облигаций категории на рыночные финансовые инструменты оказала негативное влияние на динамику СЧА фондов облигаций за прошедший квартал.

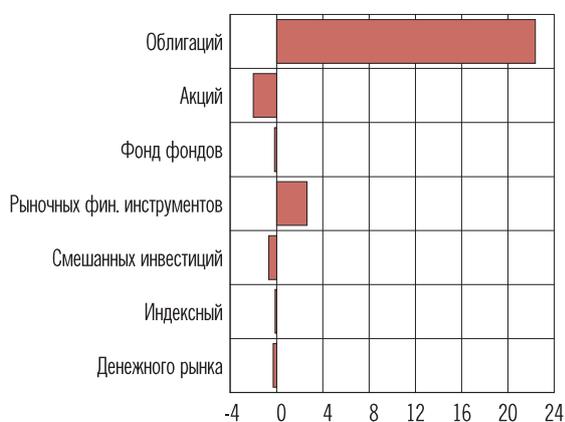
Доля ОПИФов акций снизилась: с 25,2 до 20,6%. Сокращение СЧА этой категории фондов в абсолютном выражении превысило 2 млрд рублей. Падение

¹⁰ <https://www.moex.com/ru/index/MICEXCBITR/archive/>.

¹¹ Средневзвешенная процентная ставка по депозитам в рублях для физических лиц со сроком привлечения от 1 до 3 лет (http://cbr.ru/statistics/?PrId=int_rat).

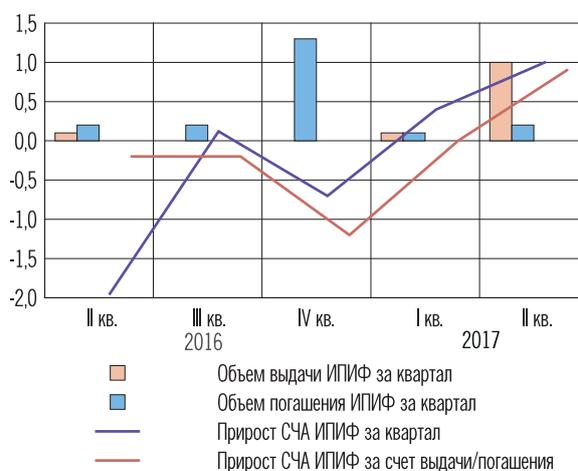
¹² http://cbr.ru/DKP/print.aspx?file=standart_system/rates_table_17.htm&pid=dkp&sid=ITM_49976.

Рисунок 1.16
Динамика СЧА отдельных категорий ОПИФов
в II квартале 2017 года (млрд руб.)



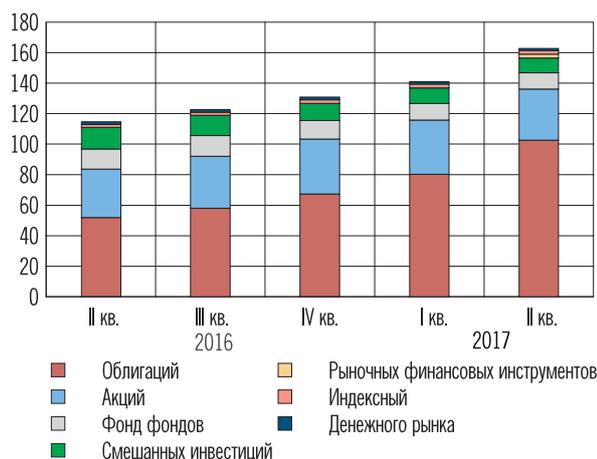
Источник: Банк России.

Рисунок 1.18
Динамика СЧА, объемов выдачи и погашения
инвестиционных паев ИПИФов (млрд руб.)



Источник: Банк России.

Рисунок 1.17
Распределение СЧА ОПИФов по категориям фондов
(млрд руб.)



Источник: Банк России.

СЧА фондов акций наблюдалось на фоне снижения стоимости этого инструмента. За II квартал 2017 года индекс ММВБ (MICEXINDEXCF) сократился на 21,4% в годовом выражении, а за I квартал – на 36,1% в годовом выражении¹³. Кроме того, пять ОПИФов акций стали фондами рыночных финансовых инструментов.

Интервальные паевые инвестиционные фонды

В II квартале количество ИПИФов уменьшилось до 36 (на начало периода – 43).

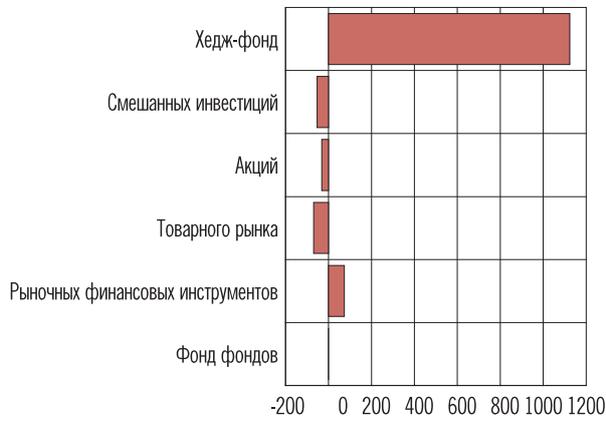
Вместе с тем СЧА этих фондов выросла на 5,6%, до 19,6 млрд рублей, а доля этого типа фондов в СЧА всех ПИФов на рынке почти не изменилась и осталась на уровне 0,7%. Прирост СЧА обеспечил нетто-приток инвестиций, который достиг 879,4 млн рублей при объеме выдачи паев 1030,3 млн рублей.

С точки зрения структуры сектора увеличение СЧА ИПИФов обеспечили хедж-фонды. За квартал СЧА этих фондов выросла более чем на 1,1 млрд рублей. Фонды других категорий показали отрицательную динамику. Исключение составила вновь созданная категория фондов – рыночных финансовых инструментов.

За счет существенного (+8,9%) увеличения СЧА хедж-фондов доля этих ИПИФов в структуре сектора выросла на 2,1 п.п. (с 68,3% на конец I квартала).

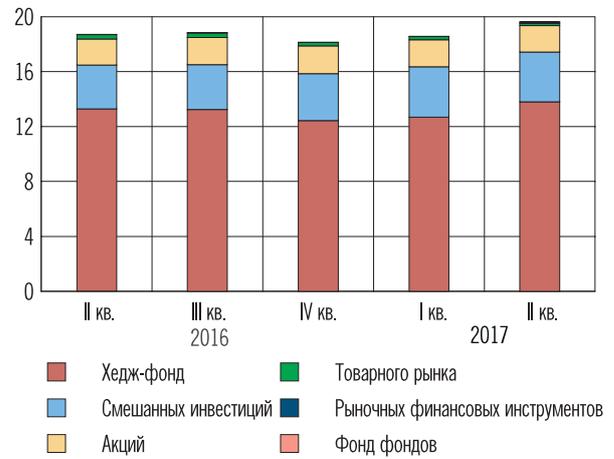
¹³ <http://moex.com/ru/index/MICEXINDEXCF/archive/>.

Рисунок 1.19
Динамика СЧА отдельных категорий ИПИФов
в II квартале 2017 года (млн руб.)



Источник: Банк России.

Рисунок 1.20
Распределение СЧА ИПИФов по категориям фондов
(млрд руб.)

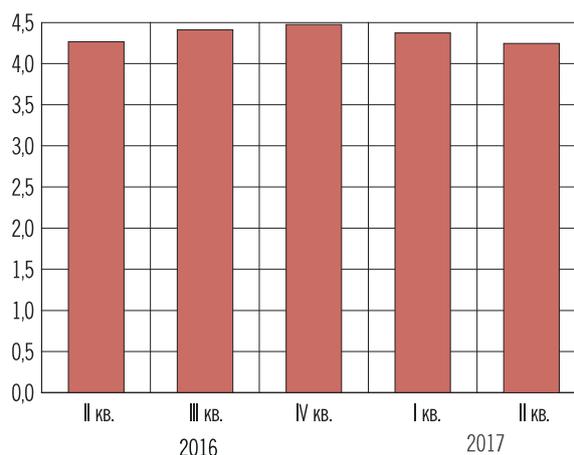


Источник: Банк России.

2. АКЦИОНЕРНЫЕ ИНВЕСТИЦИОННЫЕ ФОНДЫ

Количество АИФов за II квартал не изменилось, и на конец июня 2017 года на рынке функционировало три фонда под управлением двух УК. При этом СЧА этих фондов за прошедший квартал сократилась на 2,9%, до 4,2 млрд рублей. На конец II квартала доля крупнейшего фонда в структуре СЧА АИФов составляла 67,9%, доля наименьшего – 7,2%.

Рисунок 2.1
Динамика СЧА АИФов (млрд руб.)



Источник: Банк России.

По объему рынка ПИФов Россия отстает от большинства стран еврозоны¹

Объем рынка ПИФов России значительно меньше, чем в странах еврозоны². Так, отношение активов ПИФов к ВВП в России на 30.06.2017 составляет 3,3%, что существенно меньше значения медианы – 24,9%³ (Испания). Ниже, чем в России, показатели в Греции (3%), Латвии (1,6%) и Литве (1,5%).

Абсолютный объем активов ПИФов России (43,8 млрд евро⁴) в три раза ниже медианного значения активов инвестиционных фондов стран еврозоны – 117,8 млрд евро. В то же время среднее арифметическое значение этих стран достигает 559,4 млрд евро. Такой разрыв средних значений объясняется высокой концентрацией. На инвестиционные фонды Люксембурга приходится больше трети (34,7%) всего рынка зоны евро. Люксембург, Германия, Ирландия и Франция – страны, размер рынка каждой из которых превосходит 1 трлн евро, – составляют 82,1% от этого объема. При этом наименьший размер инвестиционных фондов зафиксирован в Латвии – 0,4 млрд евро.

Вместе с тем ПИФы в России отличаются своей «закрытостью»: доля СЧА ЗПИФов в СЧА всех ПИФов составляет 93,1% на 30.06.2017. В странах зоны евро доля закрытых фондов – лишь 2,6%.

¹ При подготовке материала под ПИФами для стран еврозоны понимались открытые (open-end) и закрытые (closed-end) инвестиционные фонды (investment funds).

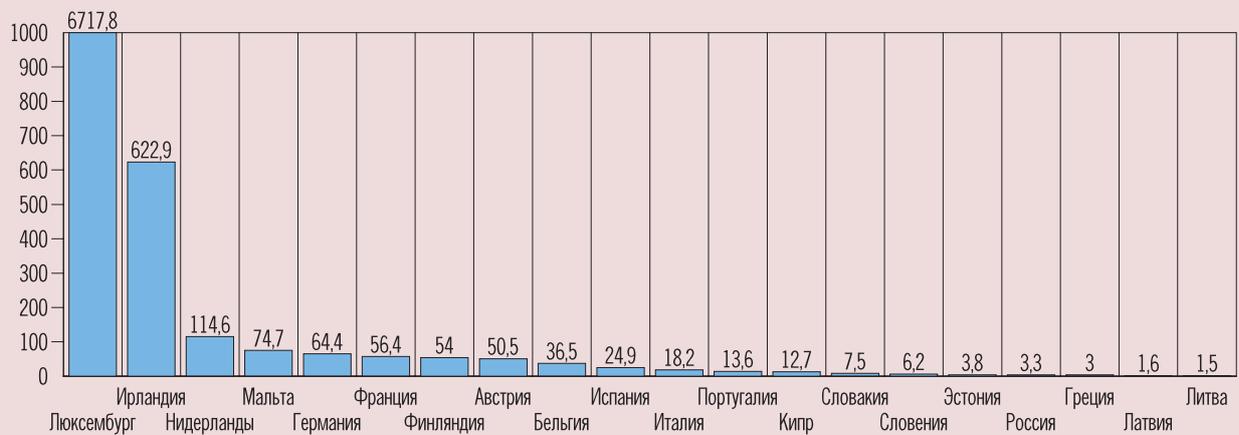
² В еврозону входит 19 стран.

³ Расчет отношения активов ПИФов к ВВП по странам еврозоны произведен с учетом данных по объему активов ПИФов каждой страны на конец мая 2017 года и объема ее ВВП за период с II квартала 2016 по I квартал 2017 года ввиду отсутствия данных за II квартал 2017 года.

⁴ Расчет произведен по курсу евро Банка России на 30.06.2017.

Рисунок 1

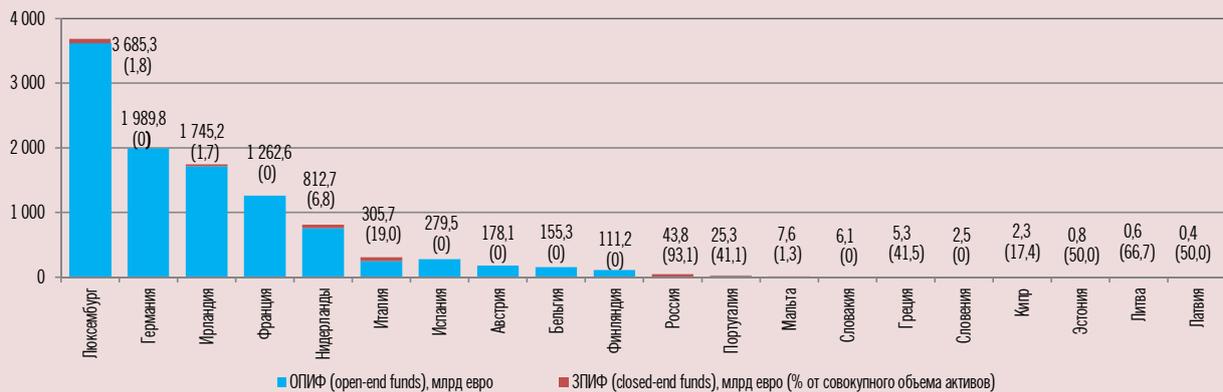
Отношение активов инвестиционных фондов к ВВП в странах еврозоны и в России, %



Источники: European Central Bank (данные на конец мая 2017 года), Банк России (данные на 30.06.2017).

Рисунок 2

Объем активов инвестиционных фондов в странах еврозоны и в России



Источники: European Central Bank (данные на конец мая 2017 года), Банк России (данные на 30.06.2017; при расчете в качестве ОПИФов были учтены активы ОПИФов и ИПИФов ввиду их розничного характера).

3. КЛЮЧЕВЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ ПАЕВЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ И АКЦИОНЕРНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

Таблица 1

Наименование показателя	Единица измерения	30.06.2016	30.09.2016	31.12.2016	31.03.2017	30.06.2017
Количество ПИФов зарегистрированных, не исключенных из реестра паевых инвестиционных фондов	ед.	1 531	1 534	1 553	1 512	1 500
Закрытые ПИФы	ед.	1 120	1 135	1 150	1 131	1 132
Открытые ПИФы	ед.	362	353	356	338	332
Интервальные ПИФы	ед.	49	46	47	43	36
Количество специализированных депозитариев, контролирурующих ПИФы (согласно сданной отчетности)	ед.	28	30	30	30	27
Количество управляющих компаний, осуществляющих ДУ ПИФов (согласно сданной отчетности)	ед.	314	308	301	292	286
Количество владельцев акций (паев) (согласно сданной отчетности)	тыс. ед.	1 458,5	1 463,3	1 466,0	1 467,9	1 473,0
Закрытые ПИФы	тыс. ед.	10,2	9,8	10,2	10,1	10,1
Открытые ПИФы	тыс. ед.	368,3	373,6	376,0	378,1	383,7
Интервальные ПИФы	тыс. ед.	1 080,1	1 080,0	1 079,7	1 079,6	1 079,2
Количество ПИФов для квалифицированных инвесторов, завершивших формирование (в том числе в стадии прекращения):	ед.	748	743	756	763	756
Концентрация						
количество ПИФов, составляющих 80% активов	ед.	210	209	188	176	184
доля ПИФов, составляющих 80% активов	%	15,4	15,0	12,8	12,7	12,3
количество УК, совместно контролирующих 80% активов	ед.	68	66	61	58	60
количество УК, совместно контролирующих 80% активов	%	21,7	19,5	20,3	19,9	21,0
количество спецдепозитариев, совместно контролирующих 80% активов	ед.	5	5	5	5	5
количество спецдепозитариев, совместно контролирующих 80% активов	%	17,9	16,7	16,7	16,7	18,5
top-20 ПИФов по СЧА	%	35,2	34,9	39,8	41,5	39,1
top-20 ПИФов по количеству участников – физических лиц	%	86,2	86,0	86,1	86,2	86,5
top-20 УК по СЧА	%	51,3	51,3	55,1	56,1	54,6
top-100 ПИФов по СЧА	%	64,9	65,0	67,8	69,1	68,0
top-100 ПИФов по количеству участников – физических лиц	%	97,2	97,2	97,3	97,5	97,5
top-100 УК по СЧА	%	88,2	88,6	89,8	90,3	90,3
Активы	млн руб.	2 618 125,1	2 675 068,3	2 835 195,3	3 033 530,0	2 955 539,0
Отношение активов к ВВП	%	3,2	3,2	3,3	3,5	3,3
Стоимость чистых активов (СЧА)	млн руб.	2 394 961,4	2 447 828,0	2 579 909,8	2 728 774,1	2 653 828,8
СЧА ПИФов для квалифицированных инвесторов	млн руб.	1 801 631,3	1 821 003,3	1 958 754,1	2 110 982,2	2 019 242,3
Обязательства по основному виду деятельности	млн руб.	223 163,7	227 240,2	255 285,6	304 756,0	301 710,3
Количество действующих АИФ	шт.	3	3	3	3	3
СЧА АИФ	млн руб.	4 266,6	4 410,9	4 477,2	4 372,5	4 245,2
Активы, в том числе	млн руб.	2 618 125,1	2 675 068,3	2 835 195,3	3 033 530,0	2 955 539,0
Денежные средства в том числе	млн руб.	190 293,0	208 412,0	194 188,3	181 345,4	190 945,7
на текущих счетах	млн руб.	140 402,7	144 656,4	134 935,9	120 751,8	132 061,1
на депозитах	млн руб.	49 890,3	63 755,6	59 252,4	60 593,6	58 884,5

Наименование показателя	Единица измерения	30.06.2016	30.09.2016	31.12.2016	31.03.2017	30.06.2017
Акции российских эмитентов (обыкновенные + привилегированные)	млн руб.	427 367,9	432 749,9	434 030,0	630 524,5	571 304,4
Облигации российских эмитентов	млн руб.	54 001,8	62 919,4	82 574,8	95 250,4	105 184,7
Государственные ценные бумаги	млн руб.	8 904,8	10 625,3	12 895,9	15 736,7	18 273,1
Ценные бумаги субъектов РФ	млн руб.	2 083,4	4 272,7	3 053,0	2 942,0	3 680,9
Муниципальные ценные бумаги	млн руб.	30,6	25,3	28,5	26,2	44,4
Иностранные ценные бумаги	млн руб.	111 399,5	116 587,0	100 321,2	92 636,2	107 751,4
Инвестиционные паи ПИФов	млн руб.	4 323,1	4 229,4	5 309,1	6 343,0	4 617,7
Вклады в уставные (складочные) капиталы российских организаций	млн руб.	294 987,3	309 131,5	484 029,8	480 545,0	478 546,1
Векселя других организаций	млн руб.	77 600,9	76 095,2	73 079,7	67 439,8	28 922,8
Недвижимость, ипотечные ценные бумаги и закладные	млн руб.	1 095 343,6	1 108 414,8	1 073 427,7	1 054 591,7	1 046 011,7
недвижимость	млн руб.	1 085 354,3	1 099 061,4	1 072 637,9	1 054 178,9	1 045 657,3
ипотечные ценные бумаги и закладные	млн руб.	9 989,3	9 353,4	789,8	412,9	354,4
Прочие активы	млн руб.	351 789,3	341 605,8	372 257,5	406 149,1	400 256,2
Стоимость чистых активов, том числе	млн руб.	2 394 961,4	2 447 828,0	2 579 909,8	2 728 774,1	2 653 828,8
Закрытые ПИФы, том числе	млн руб.	2 261 602,5	2 306 345,0	2 430 956,0	2 569 124,2	2 471 407,5
акций	млн руб.	110 091,6	114 630,2	120 330,0	117 545,1	80 400,5
денежного рынка	млн руб.	593,1	1 082,6	1 104,1	1 132,8	1 155,3
долгосрочных прямых инвестиций	млн руб.	633 227,6	663 286,2	841 071,0	852 166,0	586 709,0
ипотечный	млн руб.	11 879,2	11 491,3	1 654,5	1 428,6	1 040,9
комбинированный	млн руб.	X	X	X	152 197,6	429 534,1
кредитный	млн руб.	49 937,8	51 608,2	44 957,2	42 674,5	36 652,0
недвижимости	млн руб.	996 693,6	1 003 882,7	993 529,1	989 238,7	933 779,1
облигаций	млн руб.	1 499,0	1 477,2	1 456,7	1 556,3	1 534,3
особо рискованных (венчурных) инвестиций	млн руб.	35 118,3	32 067,7	28 094,2	28 388,4	26 304,9
прямых инвестиций	млн руб.	65 760,1	63 413,0	61 186,3	60 853,4	60 794,1
рентный	млн руб.	228 260,5	231 814,3	231 522,6	217 575,4	216 309,4
смешанных инвестиций	млн руб.	92 374,1	94 501,2	90 944,2	90 459,2	84 763,9
хедж-фонд	млн руб.	35 989,2	36 863,8	14 923,5	13 862,4	12 379,8
художественных ценностей	млн руб.	178,4	177,0	140,5	X	X
товарного рынка	млн руб.	0,0	49,6	42,0	45,8	50,1
Открытые ПИФы, том числе	млн руб.	114 640,5	122 643,8	130 805,2	141 072,1	162 800,7
акций	млн руб.	31 743,7	34 008,8	36 012,6	35 525,2	33 523,0
денежного рынка	млн руб.	1 730,7	1 723,7	1 697,2	1 706,1	1 412,8
индексный	млн руб.	1 934,5	2 049,1	2 414,2	2 442,1	2 323,9
облигаций	млн руб.	51 825,6	58 016,7	67 314,1	80 246,6	102 627,7
смешанных инвестиций	млн руб.	14 190,4	13 280,4	11 199,7	10 246,7	9 561,8
фонд фондов	млн руб.	13 215,6	13 565,1	12 167,3	10 905,4	10 728,6
рыночных финансовых инструментов	млн руб.	X	X	X	X	2 623,0
Интервальные ПИФы, том числе	млн руб.	18 718,4	18 839,3	18 148,5	18 577,8	19 620,5
акций	млн руб.	1 901,1	1 978,4	2 027,2	1 963,8	1 932,2
смешанных инвестиций	млн руб.	3 193,7	3 272,6	3 422,8	3 674,0	3 620,4
товарного рынка	млн руб.	325,3	332,5	249,5	240,1	170,9
фонд фондов	млн руб.	15,9	16,2	16,1	16,8	16,7
хедж-фонд	млн руб.	13 282,4	13 239,5	12 432,9	12 683,0	13 806,9
рыночных финансовых инструментов	млн руб.	X	X	X	X	73,3
Средневзвешенная доходность (изменение стоимости пая) с начала года	%	0,8	0,8	2,2	0,5	-0,9
Закрытые ПИФы	%	0,8	0,62	2,0	0,5	-1,0
акций	%	2,8	7,4	12,8	-0,9	1,0
денежного рынка	%	4,7	-12,3	-10,6	2,6	4,6
долгосрочных прямых инвестиций	%	6,0	6,0	12,1	2,0	1,2
ипотечный	%	2,2	1,9	-9,5	-5,7	-11,2
комбинированный	%				8,1	-1,4
кредитный	%	-9,0	-7,3	-19,4	-3,9	-9,0
недвижимости	%	-1,3	-2,3	-1,8	1,2	0,0
облигаций	%	4,6	3,1	1,6	6,8	5,3

Наименование показателя	Единица измерения	30.06.2016	30.09.2016	31.12.2016	31.03.2017	30.06.2017
особо рискованных (венчурных) инвестиций	%	-0,2	-5,4	-11,9	-0,4	-6,6
прямых инвестиций	%	-4,4	-7,2	-10,4	-0,5	-0,6
рентный	%	-2,0	-2,4	-2,2	-6,1	-7,0
смешанных инвестиций	%	4,4	6,1	4,7	0,3	-4,2
хедж-фонд	%	3,0	5,8	-8,4	-7,1	-4,3
художественных ценностей	%	-3,8	-4,9	-24,5		X
товарного рынка	%				9,0	19,3
Открытые ПИФы	%	0,3	4,1	5,5	-0,8	1,2
акций	%	3,9	11,7	18,0	-4,5	-5,2
денежного рынка	%	4,9	7,3	9,6	2,4	4,7
индексный	%	10,2	18,8	35,3	-9,5	-14,0
облигаций	%	3,1	5,1	5,4	1,7	5,0
рыночных финансовых инструментов						-4,0
смешанных инвестиций	%	-0,5	2,5	4,0	-1,3	-0,7
фонд фондов	%	-14,0	-12,5	-18,4	-2,4	4,0
Интервальные ПИФы	%	4,0	5,6	7,6	0,3	1,2
акций	%	7,0	13,4	22,2	-4,8	-5,5
рыночных финансовых инструментов						8,5
смешанных инвестиций	%	7,4	11,8	17,7	-1,0	-1,0
товарного рынка	%	-1,3	3,6	-12,9	4,3	8,4
фонд фондов	%	-0,7	1,2	1,1	4,3	4,2
хедж-фонд	%	3,1	3,6	4,4	1,5	2,8
Средневзвешенная доходность (изменение стоимости пая) за прошедший квартал	%		-0,3	-0,7	0,5	-3,1
Закрытые ПИФы	%		-0,53	-0,7	0,5	-3,4
акций	%		4,1	5,0	-0,9	1,4
денежного рынка	%		2,0	2,0	2,6	2,0
долгосрочных прямых инвестиций	%		0,9	4,3	2,0	1,5
ипотечный	%		-0,3	-84,0	-5,7	-3,2
комбинированный	%				8,1	-15,2
кредитный	%		1,5	-12,0	-3,9	-3,9
недвижимости	%		-2,1	-0,6	1,2	-1,1
облигаций	%		-1,5	-1,4	6,8	-1,4
особо рискованных (венчурных) инвестиций	%		-5,2	-7,3	-0,4	-6,2
прямых инвестиций	%		-3,0	-3,5	-0,5	-0,2
рентный	%		-0,5	-0,1	-6,1	-0,9
смешанных инвестиций	%		2,3	-3,6	0,3	-4,4
хедж-фонд	%		2,1	-59,2	-7,1	3,3
художественных ценностей	%		-1,1	-20,6	X	X
товарного рынка	%		0,0	-15,4	9,0	9,4
Открытые ПИФы	%		3,83	0,13	-0,8	1,6
акций	%		7,6	-0,1	-4,5	-2,8
денежного рынка	%		2,3	1,8	2,4	2,3
индексный	%		7,9	14,1	-9,5	-5,0
облигаций	%		2,0	0,9	1,7	3,2
рыночных финансовых инструментов	%		X	X	X	-0,3
смешанных инвестиций	%		3,3	2,2	-1,3	0,0
фонд фондов	%		2,1	-7,0	-2,4	6,4
Интервальные ПИФы	%		1,97	-3,13	0,3	0,8
акций	%		6,1	5,7	-4,8	-0,8
рыночных финансовых инструментов	%		X	X	X	3,6
смешанных инвестиций	%		4,1	4,8	-1,0	-0,1
товарного рынка	%		4,7	-22,9	4,3	4,2
фонд фондов	%		2,0	-0,6	4,3	-0,1
хедж-фонд	%		0,8	-5,9	1,5	1,3
Выдача и погашение инвестиционных паев ПИФов с начала года	млрд руб.	6,2	67,3	148,0	114,5	114,5
Закрытые ПИФы	млрд руб.	7,4	65,0	140,4	103,0	83,7
Объем выдачи ЗПИФов с начала года	млрд руб.	107,1	176,1	298,0	114,0	144,3

Наименование показателя	Единица измерения	30.06.2016	30.09.2016	31.12.2016	31.03.2017	30.06.2017
Объем погашения ЗПИФов с начала года	млрд руб.	99,7	111,1	157,7	11,0	60,6
Открытые ПИФы	млрд руб.	2,0	5,8	12,3	11,4	29,9
Объем выдачи ОПИФов с начала года	млрд руб.	22,3	40,5	58,9	19,5	46,0
Объем погашения ОПИФов с начала года	млрд руб.	20,3	34,7	46,6	8,1	16,1
Интервальные ПИФы	млрд руб.	-3,2	-3,4	-4,7	0,0	0,9
Объем выдачи ИПИФов с начала года	млрд руб.	0,2	0,2	0,2	0,1	1,1
Объем погашения ИПИФов с начала года	млрд руб.	3,4	3,6	4,9	0,1	0,2
Выдача и погашение инвестиционных паев ПИФов за квартал	млрд руб.	-25,5	61,2	80,7	114,5	0,0
Закрытые ПИФы	млрд руб.	-26,0	57,6	75,4	103,0	-19,3
Объем выдачи ЗПИФов за квартал	млрд руб.	40,1	69,0	121,9	114,0	30,3
Объем погашения ЗПИФов за квартал	млрд руб.	66,1	11,4	46,6	11,0	49,6
Открытые ПИФы	млрд руб.	0,7	3,8	6,5	11,4	18,5
Объем выдачи ОПИФов за квартал	млрд руб.	9,5	18,2	18,4	19,5	26,5
Объем погашения ОПИФов за квартал	млрд руб.	8,9	14,4	11,9	8,1	8,0
Интервальные ПИФы	млрд руб.	-0,2	-0,2	-1,2	0,0	0,9
Объем выдачи ИПИФов за квартал	млрд руб.	0,1	0,0	0,0	0,1	1,0
Объем погашения ИПИФов за квартал	млрд руб.	0,2	0,2	1,3	0,1	0,2

Таблица 2

	Прирост (+) (уменьше- ние (-) стои- мости иму- щества в резуль- тате сде- лок с иму- ществом – всего	Прирост (+) (уменьше- ние (-) стои- мости иму- щества в резуль- тате изме- нения оцено- чной стои- мости иму- щества – всего	Прирост (+) (умень- шение (-) средств в иностран- ной валюте	Доход по имуще- ству, при- надлежа- щему ак- ционерно- му инвести- ционному фонду (со- ставляю- щему пае- вой инве- стиционный фонд) – всего	Опла- та по до- говорам, в том чис- ле по дого- ворам арен- ды, права из которых составляют имущество фонда	Оплата воз- награжде- ний управ- ляющей компа- нии, специа- лизирован- ному депози- тарю, лицу, осуществля- ющему веде- ние реестра, норм управ- ления пае- вым инве- стицион- ным фондом всего	Оплата рас- ходов, свя- занных с управ- лением акцио- нерным ин- вестицион- ным фон- дом или до- веритель- ным управ- лением пае- вым инве- стицион- ным фондом	Выплата див- идендов по акциям акционер- ного инве- стиционного фонда (до- хода по ин- вестицион- ным паевым инвести- циям)	Прочие доходы	Прочие расходы	Прирост (+) имущества в результа- те размеще- ния акций ак- ционерного ин- вестиционного фонда (выда- чи инвестици- онных паев па- евого инвести- ционного фон- да)	Уменьшение (-) имущества в результа- те выкупа или приобретения акций акцио- нерного ин- вестиционно- го фонда (по- гашения ин- вестиционных паев паевого инвестицион- ного фонда)	Уменьшение (-) имущества в результа- те обмена ин- вестицион- ных паев дру- гих паевых ин- вестиционных фондов на ин- вестиционные паи данного паевого инве- стиционного фонда	Уменьшение (-) имущества в результа- те обмена ин- вестиционных паев данно- го паевого ин- вестиционного фонда на ин- вестиционные паи других па- евых инвести- ционных фон- дов	Итого: при- рост (+) или умень- шение (-) стоимости фонда (строки 01 +02+03+04 -05-06-07 -08+09-10 +11-12+13 +14)
Закрытые ПИФы, том числе	16 092,54	-32 873,76	8,84	24 863,18	943,68	3 425,90	6 419,86	63 491,25	9 698,07	17 635,58	30 288,74	-49 628,10	0,00	0,00	-93 466,75
акций	7,64	-1 385,15	1,67	50,22	0,00	73,88	0,51	0,00	27,02	51,87	1,01	0,00	0,00	0,00	-1 423,86
денежного рынка	0,28	11,84	0,00	14,21	0,00	2,71	0,05	0,00	2,73	3,85	0,00	0,00	0,00	0,00	22,45
долгосрочных пря- мых инвестиций	11 397,87	126,88	1 284,25	6 046,42	0,00	1 156,02	9,78	1 426,32	491,28	4 345,76	10 980,64	-43 420,89	0,00	0,00	-20 031,44
ипотечный	24,55	-91,23	0,00	34,71	0,00	9,81	0,98	0,00	24,33	18,94	0,00	-350,26	0,00	0,00	-387,63
комбинированный	-838,74	-18 481,61	-1 403,01	1 123,64	3,05	169,06	343,35	46 640,84	4 802,15	4 770,67	2 910,15	-297,15	0,00	0,00	-64 111,55
кредитный	-1 688,65	-1 414,20	0,07	1 291,40	0,00	92,88	15,84	466,29	394,37	112,48	522,51	-34,27	0,00	0,00	-1 616,27
недвижимости	6 592,13	-3 378,91	61,13	12 818,59	939,00	1 410,71	5 774,12	13 881,53	3 676,32	7 380,93	11 535,01	-3 251,25	0,00	0,00	-1 333,26
облигаций	0,00	-1,85	0,00	12,39	0,00	32,49	0,05	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-22,01
особо рискованных (вечнурных) инве- стиций	-11,42	-1 306,00	52,36	416,01	0,00	121,12	0,93	694,11	21,86	30,02	941,20	-648,53	0,00	0,00	-1 380,72
прямых инвестиций	304,20	-1 882,94	0,00	1 578,95	0,00	60,22	0,28	83,07	8,68	32,24	171,30	-0,08	0,00	0,00	4,32
рентный	-979,19	381,57	2,45	650,76	1,63	174,13	271,65	299,08	155,58	790,73	2 946,08	0,00	0,00	0,00	1 620,03
смешанных инве- стиций	-302,83	-4 273,86	0,00	785,29	0,00	114,96	1,95	0,00	93,35	59,78	280,84	-607,10	0,00	0,00	-4 201,00
хедж-фонд	1 581,52	-1 178,82	9,92	40,61	0,00	6,86	0,36	0,00	0,11	37,69	0,00	-1 018,57	0,00	0,00	-610,14
художественных ценностей	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
товарного рынка	5,18	0,52	0,00	0,00	0,00	1,06	0,01	0,00	0,30	0,61	0,00	0,00	0,00	0,00	4,31
Открытые ПИФы, в том числе	12,62	1 511,06	107,54	2 655,51	0,00	988,22	34,97	0,00	559,06	603,15	26 496,54	-7 987,02	10 584,31	-10 549,02	21 764,26
акций	-34,25	-258,84	32,67	486,68	0,00	333,48	12,14	0,00	191,88	195,70	1 441,64	-1 708,71	3 294,01	-3 551,06	-647,30
денежного рынка	0,02	-2,58	0,61	41,03	0,00	3,70	0,07	0,00	0,03	0,05	60,87	-385,20	10,21	-14,51	-293,34
индексный	0,18	-145,16	0,01	37,26	0,00	15,31	0,38	0,00	4,36	5,05	120,39	-84,70	57,66	-87,40	-118,13
облигаций	11,96	1 368,36	70,18	1 858,91	0,00	463,20	14,94	0,00	230,01	253,18	23 699,57	-4 353,49	5 202,20	-4 357,39	22 999,02
смешанных инве- стиций	45,91	-129,02	0,90	176,55	0,00	94,13	4,51	0,00	63,95	75,67	795,93	-647,44	138,84	-399,34	-128,05

	Прирост (+) (уменьше- ние (-) стои- мости иму- щества в резуль- тате сде- лок с иму- ществом – всего	Прирост (+) (уменьше- ние (-) стои- мости иму- щества в резуль- тате изме- нения оцен- очной стои- мости иму- щества – всего	Прирост (+) (умень- шение (-) в иностран- ной валюте	Доход по имуще- ству, при- надлежа- щему ак- ционерно- му инвести- ционному фонду (со- ставляю- щему пае- вой инве- стиционный фонд) – всего	Опла- та по до- говорам, в том чис- ле по дого- ворам арен- ды, права из которых составляют имущество фонда	Оплата воз- награжде- ний управ- ляющей ком- пани, специ- ализирован- ному депози- тарю, лицу, осуществ- ляющему веде- ние реестра, аудиторской организа- ции, оценщи- ку и бирже – всего	Оплата рас- ходов, свя- занных с управ- лением акцио- нерным ин- вестицион- ным фон- дом или до- веритель- ным управ- лением па- евым инве- стицион- ным фондом	Выплата ди- видендов по акциям акционер- ного инве- стиционного фонда (до- хода по ин- вестицион- ным паевым инвести- ционным фондам)	Прочие доходы	Прочие расходы	Прирост (+) имущества в резуль- те размеще- ния акций ак- ционерного ин- вестиционного фонда (выда- чи инвестици- онных паев па- евого инве- стиционно- го фонда)	Уменьшение (-) имущества в результа- те выкупа или приобретения акций акци- онерного ин- вестиционно- го фонда (по- гашения ин- вестиционных паев паевого инвестицион- ного фонда)	Прирост (+) имущества в результа- те обмена ин- вестицион- ных паев дру- гих паевых ин- вестиционных фондов на ин- вестиционные паи данного паевого инве- стиционно- го фонда	Уменьшение (-) имущества в результа- те обмена ин- вестиционных паев данного паевого инве- стиционно- го фонда	Итого: при- рост (+) или умень- шение (-) стоимости имущества (строки 01 +02+03+04 -05-06-07 -08+09-10 +11-12+13 +14)
фонд фондов рыночных финан- совых инструмен- тов	-7,77	713,12	0,69	25,20	0,00	64,87	1,38	0,00	54,64	59,34	356,83	-770,45	1 859,69	-2 136,18	-29,81
Интервальные ПИФы, в том числе	-3,42	-34,81	2,48	29,88	0,00	13,54	1,55	0,00	14,19	14,16	21,31	-37,04	21,69	-3,14	-18,12
акций	-64,39	134,65	19,05	292,50	0,00	97,78	3,19	0,00	498,42	616,05	1 030,27	-150,88	3,65	-3,50	1 042,72
смешанных инве- стиций	-28,99	-9,50	0,00	44,60	0,00	17,75	0,56	0,00	13,08	15,70	6,17	-20,88	0,39	-2,52	-31,64
товарного рынка	-33,60	-22,40	0,22	99,98	0,00	46,69	0,78	0,00	15,69	18,34	1,80	-51,81	3,17	-0,86	-53,64
фонд фондов	0,23	7,99	0,00	0,00	0,00	0,91	0,00	0,00	0,19	0,22	2,56	-0,37	0,08	-0,11	9,43
хедж-фонд	0,00	-2,80	0,03	2,96	0,00	0,21	0,01	0,00	0,01	0,02	0,00	0,00	0,00	0,00	-0,02
рыночных финан- совых инструмен- тов	-2,12	158,86	18,80	144,95	0,00	31,86	1,85	0,00	469,08	581,35	1 019,62	-70,24	0,00	0,00	1 123,90
	0,09	2,49	0,00	0,00	0,00	0,36	0,00	0,00	0,36	0,42	0,12	-7,59	0,00	0,00	-5,31

Таблица 3

Наименование показателя	Единица измерения	II кв. 2016	III кв. 2016	IV кв. 2016	I кв. 2017	II кв. 2017
Активы ПИФов, в том числе	млн руб.	2 618 125 114 977,3	2 675 068 257 504,1	2 835 195 343 839,6	3 033 530 005 925,4	2 955 539 007 524,4
Денежные средства, в том числе	млн руб.	190 293 008 537,0	208 412 020 001,0	194 188 265 003,9	181 345 428 627,5	190 945 667 999,2
на текущих счетах	млн руб.	140 402 729 546,7	144 656 371 977,7	134 935 897 765,6	120 751 822 857,1	132 061 130 185,8
на депозитах	млн руб.	49 890 278 990,3	63 755 648 023,3	59 252 367 238,3	60 593 605 770,4	58 884 537 813,4
Акции российских эмитентов (обыкновенные + привилегированные)	млн руб.	427 367 942 676,7	432 749 910 618,2	434 030 031 171,2	630 524 473 453,9	571 304 400 410,6
Облигации российских эмитентов	млн руб.	54 001 754 353,1	62 919 424 302,5	82 574 771 971,2	95 250 410 710,2	105 184 691 422,6
Государственные ценные бумаги	млн руб.	8 904 785 446,1	10 625 291 439,7	12 895 912 035,4	15 736 678 545,0	18 273 061 694,2
Ценные бумаги субъектов РФ	млн руб.	2 083 405 167,8	4 272 657 823,7	3 052 990 113,4	2 942 024 752,5	3 680 853 837,2
Муниципальные ценные бумаги	млн руб.	30 631 426,1	25 286 110,1	28 464 765,0	26 169 979,6	44 427 759,6
Иностранные ценные бумаги	млн руб.	111 399 451 450,4	116 587 019 007,1	100 321 189 790,3	92 636 208 899,7	107 751 434 032,5
Инвестиционные паи ПИФов	млн руб.	4 323 103 685,7	4 229 363 838,5	5 309 052 743,9	6 342 958 534,9	4 617 737 041,3
Вклады в уставные (складочные) капиталы российских организаций	млн руб.	294 987 273 575,1	309 131 476 745,8	484 029 759 212,6	480 544 988 141,2	478 546 067 641,4
Векселя других организаций	млн руб.	77 600 851 685,1	76 095 225 920,8	73 079 706 411,2	67 439 782 037,8	28 922 757 340,8
Недвижимость, ипотечные ценные бумаги и закладные, в том числе	млн руб.	1 095 343 629 109,5	1 108 414 776 141,1	1 073 427 714 256,5	1 054 591 734 668,8	1 046 011 670 273,6
недвижимость	млн руб.	1 085 354 320 626,6	1 099 061 367 406,0	1 072 637 939 540,8	1 054 178 881 323,6	1 045 657 304 315,0
ипотечные ценные бумаги и закладные	млн руб.	9 989 308 482,9	9 353 408 735,1	789 774 715,6	412 853 345,3	354 365 958,6
Прочие активы	млн руб.	351 789 277 864,7	341 605 805 555,6	372 257 486 364,9	406 149 147 574,3	400 256 238 071,5
Активы ЗПИФов, в том числе	млн руб.	2 483 047 107 752,5	2 531 435 343 492,0	2 684 434 744 899,3	2 871 965 603 321,2	2 770 650 005 624,0
Денежные средства, в том числе	млн руб.	184 405 290 236,3	202 970 276 222,9	188 468 253 707,0	174 835 674 308,7	182 679 290 845,4
на текущих счетах	млн руб.	137 480 597 441,7	141 684 891 315,8	131 341 218 344,9	116 461 185 350,3	128 340 099 827,5
на депозитах	млн руб.	46 924 692 794,6	61 285 384 907,0	57 127 035 362,1	58 374 488 958,4	54 339 191 018,0
Акции российских эмитентов (обыкновенные + привилегированные)	млн руб.	397 407 409 679,4	399 551 133 046,4	396 312 116 266,4	592 934 284 515,3	535 201 628 669,3
Облигации российских эмитентов	млн руб.	17 602 414 572,3	21 781 070 881,3	34 499 402 079,8	37 949 731 162,0	34 536 525 573,7
Государственные ценные бумаги	млн руб.	946 285 248,5	2 043 187 373,5	1 735 568 466,5	1 699 176 312,1	944 271 902,3
Ценные бумаги субъектов РФ	млн руб.	57 089 844,8	2 542 852 005,5	58 641 348,8	57 554 805,1	35 781 954,6
Муниципальные ценные бумаги	млн руб.	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Иностранные ценные бумаги	млн руб.	65 880 560 374,8	70 119 792 545,8	60 987 821 356,6	55 424 813 083,0	65 636 827 048,5
Инвестиционные паи ПИФов	млн руб.	4 279 469 038,3	4 178 130 473,4	5 255 714 701,6	6 293 037 771,4	4 568 722 427,7
Вклады в уставные (складочные) капиталы российских организаций	млн руб.	294 987 273 575,1	309 131 476 745,8	484 029 759 212,6	480 544 988 141,2	478 546 067 641,4
Векселя других организаций	млн руб.	77 600 851 685,1	76 095 225 920,8	73 079 706 411,2	67 439 782 037,8	28 922 757 340,8
Недвижимость, ипотечные ценные бумаги и закладные, в том числе	млн руб.	1 095 343 629 109,5	1 108 414 776 141,1	1 073 427 714 256,5	1 054 591 734 668,8	1 046 011 670 273,6
недвижимость	млн руб.	1 085 354 320 626,6	1 099 061 367 406,0	1 072 637 939 540,8	1 054 178 881 323,6	1 045 657 304 315,0
ипотечные ценные бумаги и закладные	млн руб.	9 989 308 482,9	9 353 408 735,1	789 774 715,6	412 853 345,3	354 365 958,6
Прочие активы	млн руб.	344 536 834 388,3	334 607 422 135,6	366 580 047 092,3	400 194 826 515,8	393 566 461 946,8
Активы ИПИФов, в том числе	млн руб.	19 076 141 759,3	19 142 159 595,8	18 406 261 457,9	18 951 464 991,3	19 986 860 859,2
Денежные средства, в том числе	млн руб.	843 811 898,1	1 142 455 794,4	910 897 350,6	1 402 774 838,4	3 713 728 692,7

Наименование показателя	Единица измерения	II кв. 2016	III кв. 2016	IV кв. 2016	I кв. 2017	II кв. 2017
на текущих счетах	млн руб.	143 811 898,1	394 955 794,4	140 250 424,3	496 147 468,6	269 399 870,8
на депозитах	млн руб.	700 000 000,0	747 500 000,0	770 646 926,2	906 627 369,9	3 444 328 821,9
Акции российских эмитентов (обыкновенные + привилегированные)	млн руб.	7 322 687 603,1	7 408 109 567,1	8 180 449 778,8	7 891 958 348,3	7 927 435 293,8
Облигации российских эмитентов	млн руб.	5 028 274 037,8	2 761 596 549,2	5 028 793 251,6	5 216 139 466,1	2 489 891 823,7
Государственные ценные бумаги	млн руб.	320 724 470,1	105 718 376,2	188 512 785,6	239 054 103,3	397 434 735,2
Ценные бумаги субъектов РФ	млн руб.	111 037 295,0	183 189 433,5	23 800 482,7	63 973 265,0	36 334 437,2
Муниципальные ценные бумаги	млн руб.	0,0	0,0	0,0	0,0	2 388 390,5
Иностранные ценные бумаги	млн руб.	4 354 380 627,9	6 108 066 281,9	3 046 386 168,1	3 084 332 959,2	4 166 731 101,8
Инвестиционные паи ПИФов	млн руб.	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Вклады в уставные (складочные) капиталы российских организаций	млн руб.	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Векселя других организаций	млн руб.	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Недвижимость, ипотечные ценные бумаги и закладные, в том числе	млн руб.	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
недвижимость	млн руб.	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ипотечные ценные бумаги и закладные	млн руб.	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Прочие активы	млн руб.	1 095 225 827,2	1 433 023 593,6	1 027 421 640,5	1 053 232 010,9	1 252 916 384,4
Активы ОПИФов, в том числе	млн руб.	116 001 865 465,6	124 490 754 416,3	132 354 337 482,4	142 612 937 613,0	164 902 141 041,2
Денежные средства, в том числе	млн руб.	5 043 906 402,6	4 299 287 983,7	4 809 113 946,4	5 106 979 480,4	4 552 648 461,1
на текущих счетах	млн руб.	2 778 320 206,9	2 576 524 867,5	3 454 428 996,4	3 794 490 038,3	3 451 630 487,6
на депозитах	млн руб.	2 265 586 195,8	1 722 763 116,2	1 354 684 950,0	1 312 489 442,1	1 101 017 973,5
Акции российских эмитентов (обыкновенные + привилегированные)	млн руб.	22 637 845 394,2	25 790 668 004,7	29 537 465 126,0	29 698 230 590,3	28 175 336 447,5
Облигации российских эмитентов	млн руб.	31 371 065 743,0	38 376 756 872,0	43 046 576 639,8	52 084 540 082,1	68 158 274 025,2
Государственные ценные бумаги	млн руб.	7 637 775 727,5	8 476 385 690,0	10 971 830 783,3	13 798 448 129,6	16 931 355 056,7
Ценные бумаги субъектов РФ	млн руб.	1 915 278 027,9	1 546 616 384,7	2 970 548 281,9	2 820 496 682,3	3 608 737 445,5
Муниципальные ценные бумаги	млн руб.	30 631 426,1	25 286 110,1	28 464 765,0	26 169 979,6	42 039 369,1
Иностранные ценные бумаги	млн руб.	41 164 510 447,6	40 359 160 179,5	36 286 982 265,7	34 127 062 857,5	37 947 875 882,2
Инвестиционные паи ПИФов	млн руб.	43 634 647,4	51 233 365,1	53 338 042,3	49 920 763,5	49 014 613,6
Вклады в уставные (складочные) капиталы российских организаций	млн руб.	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Векселя других организаций	млн руб.	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Недвижимость, ипотечные ценные бумаги и закладные, в том числе	млн руб.	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
недвижимость	млн руб.	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
ипотечные ценные бумаги и закладные	млн руб.	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
Прочие активы	млн руб.	6 157 217 649,2	5 565 359 826,4	4 650 017 632,1	4 901 089 047,6	5 436 859 740,3

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

Общие положения

В таблице раздела 3 представлены показатели, характеризующие деятельность акционерных инвестиционных фондов (далее – АИФ) и паевых инвестиционных фондов (далее – ПИФ), с разбивкой по типам и категориям паевых инвестиционных фондов: количество ПИФов зарегистрированных, не исключенных из реестра паевых инвестиционных фондов по типам, количество действующих АИФов, количество управляющих компаний, совместно контролирующих 80% активов ПИФов, количество специализированных депозитариев, совместно контролирующих 80% активов 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, обязательства по основному виду деятельности ПИФов (сумма кредиторской задолженности, резервов предстоящих расходов на выплату вознаграждения, резервов для возмещения предстоящих расходов, связанных с доверительным управлением), средневзвешенная доходность ПИФов с разбивкой по типам и категориям ПИФов (среднее изменение стоимости пая), выдача и погашение инвестиционных паев ПИФов за квартал с разбивкой по типам ПИФов.

Показатели формируются на основе агрегированных данных отчетов акционерных инвестиционных фондов и управляющих компаний паевых инвестиционных фондов, предоставленных в Банк России в соответствии с Положением об отчетности акционерного инвестиционного фон-

да и отчетности управляющей компании паевого инвестиционного фонда, утвержденного постановлением ФКЦБ России от 22.10.2003 №03-41/инвестиционного фонда и отчетности управляющей компании паевого инвестиционного фонда, утвержденного постановлением ФКЦБ России от 22.10.2003 №03-41/пс, а также Указанием Банка России от 16.12.2015 №3901-У.

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) (далее – СЧА ПИФ (АИФ)) 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, резервов предстоящих расходов на выплату вознаграждения, а также резервов для возмещения предстоящих расходов, связанных с доверительным управлением.

Прочие обязательства ПИФов представляют собой разность между активами ПИФов, обязательствами по основному виду деятельности и величиной капитала.

Средневзвешенная доходность (изменение стоимости пая) рассчитывается на отчетную дату за период с начала года.

Расчет средневзвешенной доходности в процентах годовых производится на основе показателя доходности за период с начала года.

Выдача и погашение инвестиционных паев ПИФов представляет собой сум-

му показателей выдачи инвестиционных паев ПИФов и сумму показателей погашения инвестиционных паев ПИФов. В расчете учитываются ПИФы, сформированные в отчетном периоде, и ПИФы, находящиеся на стадии прекращения.

