

ПОЯСНЕНИЕ ПО ЗАПОЛНЕНИЮ Опросника брокерских компаний в отношении портрета их клиентов.

Опросник содержит 17 вопросов.

Вопросы 3 и 3.1 заполняются в случае наличия технической возможности произвести расчет.

Опросник заполняется исключительно в отношении клиентов-физических лиц на брокерском обслуживании на основе только той информации, что находится в распоряжении брокера.

Опросник заполняется в отношении деятельности исключительно опрашиваемой организации (если в группу компаний опрашиваемой организации входит несколько компаний, имеющих брокерскую лицензию, данные представляются исключительно по клиентам опрашиваемой организации).

Ответы на вопросы 2- 5, 10 заполняются **без округления**, с указанием максимально возможного (не менее 2 знаков после запятой) значения.

Единицы измерения в вопросах 1, 6-9, 11-17 – физические лица. Например, ответ на вопрос 1 должен содержать количество лиц соответствующего пола и возраста, принадлежащих определенной когорте. Ответ на вопрос 2, 4 заполняется в миллиардах рублей, вопрос 5 в днях, вопрос 10 – в единицах инструментов, вопросы 3 и 3.1 – в процентах.

Перед заполнением разделов опросника необходимо заполнить следующие разделы:

- ИНН опрашиваемой организации;
- Наименование опрашиваемой организации;
- ФИО исполнителя, ответственного за заполнение анкеты;
- Телефон исполнителя, ответственного за заполнение анкеты, с указанием добавочного номера в случае его наличия;
- Адрес электронной почты исполнителя, ответственного за заполнение анкеты.

Убедительно просим при заполнении опросника не изменять анкету, не форматировать ячейки, не добавлять дополнительные строки и столбцы в форму, не удалять и не скрывать имеющиеся строки и столбцы. В случае необходимости оставить комментарии к расчету используйте поле «комментарии» по столбцу О формы опросника.

Пояснения к заполнению опросника

1. При ответе на вопросы опросника необходимо указывать информацию по состоянию на 30.06.2022 (вопросы 1-2, 4, 10-14), а также за период с 31.12.2021 по 30.06.2022 (вопросы 3, 5-9, 15, 16). Ответ на вопрос 17 указывается за период, указанный в вопросе.
2. На каждый вопрос, кроме 17, необходимо отвечать в соответствии с половозрастной структурой групп клиентов:

- Мужчины (столбцы С-Н) и Женщины (столбцы I-N);
- Возраст (столбцы С-Н).

Возраст клиента определяется по соответствующим возрастным группам. Например, группа 20-30 лет включает в себя клиента, которому по состоянию на 30.06.2022 исполнилось 20 лет, но не включает в себя клиента, которому исполнилось 30 лет.

3. В случае, если брокер не предоставляет отдельных услуг, например, возможность совершения маржинальных сделок, то при ответе на соответствующие вопросы указывается 0. Если ответ на вопрос не может быть заполнен по каким-либо причинам, поля ответа остаются пустыми, а в поле комментариев по столбцу О указываются соответствующие пояснения.
4. Вопросы 1, 2, 4, 6-11, 15, 16 предполагают детализацию ответов не только по половозрастной структуре, но и, например, по размеру портфеля клиента (здесь и далее портфель клиента определяется исходя из требований действующих Указаний Банка России¹). Так, для ответа на 1 вопрос необходимо заполнить информацию в отношении мужчин и женщин различных возрастов, имеющих различный объем портфеля. Объем портфеля «(10 тыс. руб.; 100 тыс. руб.】 предполагает, что в эту группу попадают клиенты, портфель которых на 30.06.2022 составлял от 10 тыс. руб. и 01 коп. и до 100 тыс. руб. 00 коп. включительно.
5. При определении количества клиентов необходимо учитывать именно количество лиц, а не договоров. В случае наличия у одного клиента нескольких договоров, необходимо их учитывать в рамках одного лица, а все активы по счетам такого клиента суммировать.
6. Совокупное количество клиентов физических лиц, указанных при ответе на вопрос 1 должно соответствовать количеству клиентов физических лиц, отчитанных по формам 0420418 и 0409707 на 30.06.2022 (01.07.2022).
7. Совокупный объем активов физических лиц, указанных при ответе на вопрос 2 должен соответствовать объему активов физических лиц, отчитанных по формам 0420418 и 0409707 на 30.06.2022 (01.07.2022) (сумма денежных средств, ценных бумаг, требований за вычетом обязательств и в случае с 0420418 формой драгоценных металлов клиентов).
8. При ответе на вопрос 3 необходимо указать средневзвешенную по объему портфелей на 30.06.2022 соответствующей группы клиентов с непустыми счетами доходность.

Доходность (Y) по каждому отдельному клиенту определяется по формуле:

$$Y_{\text{кл}} = (Q_1 - Q_0 - In + Out) / Q_0, \text{ где}$$

Q_1 – объем портфеля клиента на 30.06.2022

¹ Отчетность по форме 0420418 "Сведения об осуществлении профессиональным участником рынка ценных бумаг брокерской, депозитарной деятельности, деятельности по управлению ценными бумагами и деятельности по инвестиционному консультированию" – сумма денежных средств, ценных бумаг, требованиям за вычетом обязательств.

Отчетность по форме 0409707 «Сведения об осуществлении брокерской, депозитарной деятельности, деятельности по управлению ценными бумагами и инвестиционному консультированию» - сумма совокупных положительных и совокупных отрицательных позиций.

Q_0 – объем портфеля клиента на 31.12.2021 или на дату первого введения средств клиентов, если по состоянию на 31.12.2021 размер их счета был равен 0 (т.е. первичный ввод средств (In) по клиенту приравнивается Q_0 и не учитывается в показателе In).

In – вводы, осуществленные клиентом за период между 01.01.2022 (датой заключения договора) и 30.06.2022

Out – выводы, осуществленные клиентами за период между 01.01.2022 (датой заключения договора) и 30.06.2022

Под вводом понимается:

- Ввод (внешний) денежных средств (сумма денежных средств, зачисленных в интересах клиента на брокерское обслуживание, не являющихся оплатой от контрагентов по ранее заключенным сделкам в интересах клиента, доходами по ценным бумагам (дивиденды, купоны и т.д., в том числе передаваемых внутри сделки РЕПО) и иным финансовым инструментам. Для валютных вводов - в рублях по курсу ЦБ на дату ввода.
- Ввод (внешний) ценных бумаг (совокупная оценка ценных бумаг, зачисленных в интересах клиента на брокерское обслуживание за отчетный период, за исключением ценных бумаг и иных финансовых инструментов, поступающих от контрагентов в рамках расчетов по ранее заключенным сделкам). Исключаются зачисления по корпоративным событиям (сплиты и пр.). Для валютных ЦБ - в рублях по курсу ЦБ на дату ввода. Стоимость ЦБ определяется на дату конкретного ввода.
- Ввод (внешний) иных активов (совокупная оценка иных активов, зачисленных в интересах клиента на брокерское обслуживание). Применяется логика, аналогичная вводу денежных средств или ценных бумаг, оставляющая только "новые", введенные клиентом или в его интересах иные активы на брокерское обслуживание. Для валютных - в рублях по курсу ЦБ на дату ввода. Стоимость иных активов определяется на дату конкретного ввода.

Под выводом понимается:

- Вывод (внешний) денежных средств (сумма денежных средств, выведенных в интересах клиента с брокерского обслуживания, не являющихся оплатой от контрагентов по ранее заключенным сделкам в интересах клиента (в т.ч. РЕПО), расходами и движениями по иным финансовым инструментам). Исключаются комиссии, налоги, возмещение расходов. Для валютных выводов оценка берется в рублях по курсу ЦБ на дату ввода.
- Вывод (внешний) ценных бумаг (совокупная оценка ценных бумаг, списанных клиентом с брокерского, исключая комиссии по сделкам и иные расходы, связанные с инвестированием и корпоративными событиями). Также не включаются выбытия ценных бумаг в рамках расчетов по ранее заключенным сделкам. Для валютных ЦБ

- в рублях по курсу ЦБ на дату вывода. Стоимость ЦБ определяется на дату конкретного вывода.

- Вывод (внешний) иных активов (совокупная оценка иных активов, списанных клиентом с брокерского обслуживания). Применяется логика, аналогичная выводу денежных средств или ценных бумаг, оставляющая только выведенные клиентом иные активы с брокерского обслуживания. Для иных активов в валюте - в рублях по курсу ЦБ на дату вывода. Стоимость иных активов определяется на дату конкретного вывода.

Средневзвешенная доходность отдельной группы клиентов определяется по формуле:

$$Y_{гр} = \sum \frac{Y_{кл_i} * Q_{1i}}{Q_{гр}}, \text{ где:}$$

$Y_{кл_i}$ – доходность отдельного клиента, рассчитанная по формуле выше

Q_{1i} – объем портфеля данного клиента на 30.06.2022

$Q_{гр}$ – объем портфелей всех клиентов, которые относятся к соответствующей половозрастной группе и имеют соответствующий размер портфеля на 30.06.2022.

9. При ответе на вопрос 4 под иностранными активами понимаются ценные бумаги и другие активы, выпущенные нерезидентами, а также денежные средства в валюте, отличной от рубля. Понятие "нерезидент" используются в соответствии с Федеральным законом от 10 декабря 2003 года N 173-ФЗ "О валютном регулировании и валютном контроле" (пункт 7 части 1 статьи 1 главы 1).
10. В вопросах 5, 6, 10-15 ответ считается только в отношении клиентов, размер счета которых по состоянию на 30.06.2022 больше 0.
11. При ответе на вопрос 5 необходимо определить отношение совокупного количества дней в течение первого полугодия 2022 года, в которые клиент заключал хотя бы одну сделку купли-продажи и/или сделку РЕПО, к 6 месяцам. В рамках ответа на данный вопрос не учитываются сделки РЕПО по переносу необеспеченной или непокрытой позиции. Пример расчета: в случае наличия 2 клиентов в поло-возрастной группе, 1 из которых торговал в течение первого полугодия каждый рабочий день (117 дней), а другой клиент торговал 1 раз в неделю ($1*4*6=24$ дня), среднее по группе равняется $11,75$ ($((117+24) / 2 \text{ клиента}) / (6 \text{ месяцев}))$).
12. В рамках ответа на вопрос 6 не учитываются сделки РЕПО по переносу необеспеченной или непокрытой позиции. Количество совершенных сделок определяется исходя из среднемесячного количества сделок. Пример расчета: в случае наличия 2 клиентов в половозрастной группе, 1 из которых заключил 15 сделок, а второй – 1400 сделок, по каждому из них определяется среднемесячное количество сделок, т.е. $15/6=2,5$ сделки в месяц, что соответствует группе от 1 до 5 сделок и $1400/6=233,33$ сделки, что соответствует группе от 201 до 2000 сделок. Получившийся результат среднего количества сделок округляется

вверх, т.е. если клиент совершил 5 сделок за полгода, то его результат $5/6=0,83$ будет соответствовать группе от 1 до 5 сделок.

13. Сумма количества клиентов по вопросам 6 и 11 должна соответствовать сумме количества клиентов по вопросу 1 по всем когортам, кроме «Отрицательный портфель» и «Пустые счета (0 руб.)».
14. Под маржинальной сделкой в вопросе 7 понимается сделка за счет денежных средств и (или) ценных бумаг и (или) драгоценных металлов, которые в соответствии с договором о брокерском обслуживании находятся в распоряжении брокера или должны поступить в его распоряжение, в случае их недостаточности для исполнения обязательств из указанных сделок.
15. Под сделкой короткой продажи в вопросе 8 понимается сделка, в результате которой возникает или увеличивается в абсолютном выражении непокрытая или временно непокрытая позиция по ценной бумаге. Расчет коротких продаж может быть сделан исходя из самих сделок или из сделок РЕПО по переносу позиции.
16. При ответе на вопрос 10 необходимо указать среднее количество финансовых инструментов, находящихся в портфеле клиентов. Под финансовым инструментом понимается каждый отдельный выпуск ценной бумаги, каждый отдельный производный финансовый инструмент, каждая иностранная валюта. Рубли на счете клиента при подсчете количества финансовых инструментов не учитываются.
17. При ответе на вопрос 15 необходимо указать количество клиентов с непустыми счетами (являющихся клиентами брокера по состоянию на 30.06.2022), использовавших в течение периода с 01.01.2022 по 30.06.2022 соответствующий способ направления торговых поручений брокеру, а также операций по вводу и выводу денежных средств. В случае, если клиент использовал несколько способов подачи поручений, он учитывается во всех категориях. Под торговыми поручениями подразумеваются поручения на совершение сделок купли-продажи ценных бумаг, заключение сделок РЕПО, ввод и вывод активов с брокерского счета и между брокерскими счетами.
18. В вопросе 16 в каждой строке указывается количество клиентов, заключивших за рассматриваемый период договор на брокерское обслуживание соответствующим способом. Сумма значений количества клиентов по строкам онлайн и офлайн, равняется общему количеству клиентов, заключивших договор с брокером за период с 1 января по 30 июня 2022 года.
19. В вопросе 17 необходимо исходить из действующих по состоянию на 30.06.2022 клиентов, а также дате открытия их первого действующего счета. Совокупное количество клиентов по вопросу 17 должно соответствовать сумме клиентов по вопросу 1.

Перед отправкой файл анкеты необходимо переименовать в формате «ИНН организации_Наименование организации». Например: 7711111111_ООО “2 брокер”.xlsx .

При возникновении вопросов по заполнению опросника Вы можете обратиться к следующему ответственному работнику Банка России: Шмаков Никита Игоревич, 8 (495) 771 99 99, доб. 7 43 88.