



Банк России

Центральный банк Российской Федерации



№ 1

2017

Информационно-
аналитические
материалы

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

Москва

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

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

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

СОДЕРЖАНИЕ

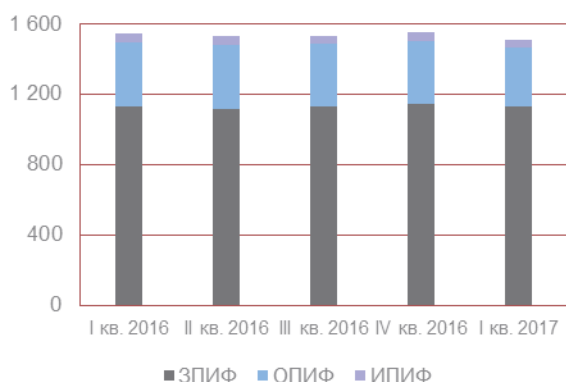
| | |
|---|----|
| 1. ПАЕВЫЕ ИНВЕСТИЦИОННЫЕ ФОНДЫ..... | 5 |
| 2. АКЦИОНЕРНЫЕ ИНВЕСТИЦИОННЫЕ ФОНДЫ..... | 12 |
| 3. КЛЮЧЕВЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ ПАЕВЫХ И АКЦИОНЕРНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ..... | 14 |
| 4. МЕТОДИЧЕСКИЕ ПОЯСНЕНИЯ К КЛЮЧЕВЫМ ПОКАЗАТЕЛЯМ ПАЕВЫХ И АКЦИОНЕРНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ..... | 22 |

1. ПАЕВЫЕ ИНВЕСТИЦИОННЫЕ ФОНДЫ¹

За I квартал 2017 года сумма чистых активов (далее СЧА) ПИФов выросла на 148,9 млрд рублей, до 2 728,8 млрд рублей. Прирост на 114,5 млрд рублей обеспечил нетто-приток инвестиций: объем выдачи паев достиг 133,6 млрд рублей при объеме погашений 19,1 млрд рублей. В то же время количество ПИФов сократилось до 1 512 (-41). При этом в связи с изменениями в регулировании на рынке стали появляться фонды новой категории – комбинированные. За I квартал 2017 года были зарегистрированы правила доверительного управления первых 18 вновь созданных комбинированных ЗПИФов под управлением 16 управляющих компаний. Кроме того, 28 существующих ЗПИФов изменили свою категорию и стали комбинированными. К концу марта СЧА комбинированных фондов достигла 152,2 млрд рублей, что составляло 5,6% от СЧА всех ПИФов.

За I квартал 2017 года количество зарегистрированных ПИФов² сократилось до 1 512 (-41). При этом уменьшилось число фондов всех типов: ЗПИФов – на 19, ОПИФов – на 18, ИПИФов – на 4.

Рисунок 1.1
Количество зарегистрированных ПИФов³ по типам (ед.)



Источник: Банк России

В то же время количество фондов для квалифицированных инвесторов увеличилось до 763 (на начало периода 756).

На фоне сокращения числа фондов концентрация на рынке увеличилась. На конец марта

¹ Обзор подготовлен на основе данных отчетности, предоставленной управляющими компаниями 1 403 ПИФов и 3 АИФов на 28.04.2017.

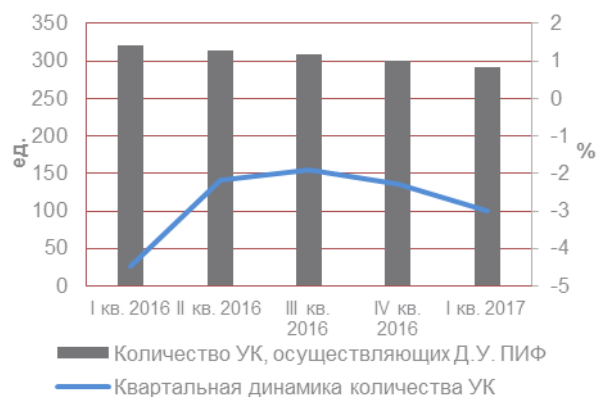
² Зарегистрированные ПИФы включают в себя фонды, – не начавшие формирование, – в стадии формирования, – с истекшим сроком формирования, – завершившие формирование, – с истекшим сроком действия договора ДУ, – в стадии прекращения.

³ См. сноску 2.

2017 года топ-20 фондов аккумулировали 41,5% СЧА ПИФов (+1,7 п.п. за квартал), топ-100 – 69,1% (+1,4 п.п.).

Вместе с тем, продолжается уменьшение

Рисунок 1.2
Количество управляющих компаний, осуществляющих Д.У. ПИФ



Источник: Банк России

числа компаний, управляющих ПИФами. В I квартале 2017 года их количество снизилось с 301 до 292.

С начала года объем активов ПИФов увеличился на 198,3 млрд рублей или 7% в относительном выражении. Отношение этих средств (3 033,5 млрд рублей) к ВВП за последние 12 месяцев составило 3,5% на конец марта 2017 года (3,3% кварталом ранее).

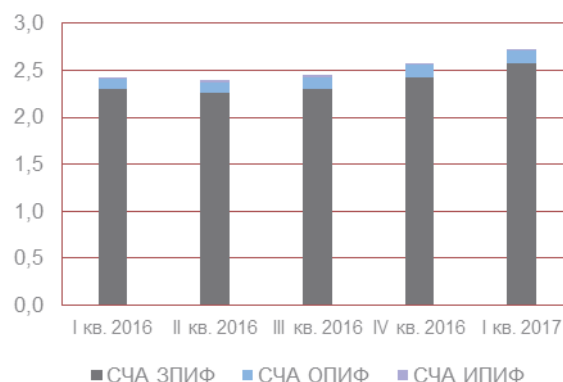
СЧА ПИФов за I квартал 2017 года выросла до 2 728,8 млрд рублей (+148,9 млрд рублей или +5,8%). Основной прирост (114,5 млрд

Рисунок 1.3
Динамика активов ПИФов



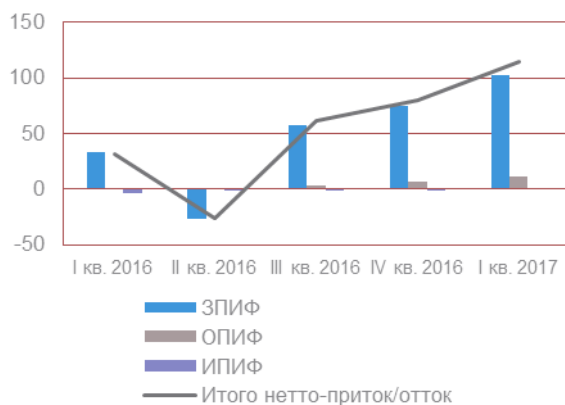
Источник: Банк России

Рисунок 1.5
Стоимость чистых активов по типам ПИФов
(трлн рублей)



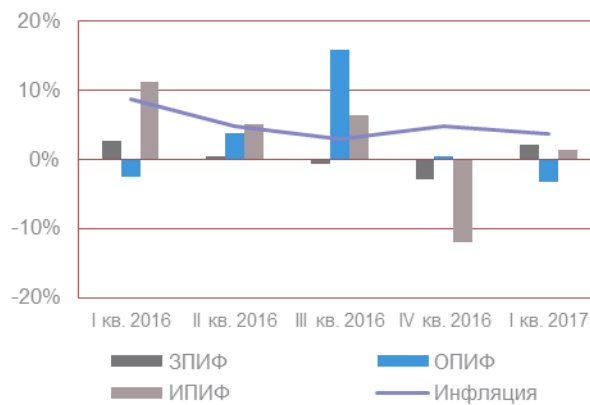
Источник: Банк России

Рисунок 1.4
Чистая выдача/погашение инвестиционных паев
(млрд рублей)



Источник: Банк России

Рисунок 1.6
Динамика квартальной средневзвешенной до-
ходности ПИФов и инфляции (% годовых)



Источник: Банк России

рублей) обеспечил нетто-приток инвестиций: объем выдачи паев достиг 133,6 млрд рублей при объеме погашений 19,1 млрд рублей. Кроме того, доход по имуществу фондов⁴ составил 26,6 млрд рублей, прирост стоимости имущества в результате сделок⁵ – 16,8 млрд рублей. Выплата дохода по паям⁶ превысила 14,3 млрд рублей.

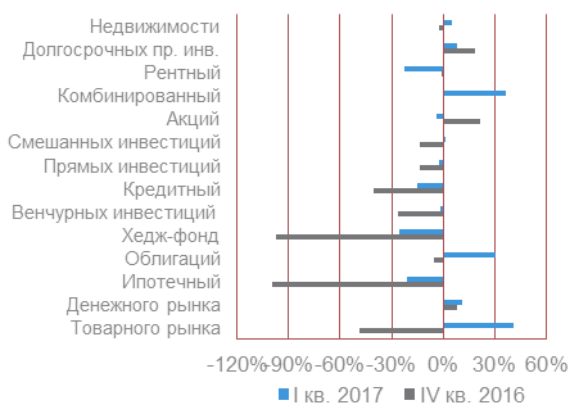
⁴ Доход по имуществу, принадлежащему акционерному инвестиционному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) по данным формы 0420503 Указания Банка России от 16.12.2015 N 3901-У "О сроках и порядке составления и представления в Банк России отчетности акционерного инвестиционного фонда и отчетности управляющей компании инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов" (Зарегистрировано в Минюсте России 28.01.2016 N 40887).

Приток инвестиций обеспечили, в том числе, и новые пайщики в секторе ОПИФов. Так, за квартал количество владельцев паев открытых фондов увеличилось на 2,1 тыс., до 378,1 тыс. При этом число пайщиков в сегменте ЗПИФов уменьшилось на 97, до 10,1 тыс., в сегменте ИПИФов – на 70, до 1 079,6 тыс. Как итог к концу I квартала 2017 года совокупное количество пайщиков выросло до 1 467,9 тыс.

⁵ Прирост/уменьшение стоимости имущества в результате сделок с имуществом по данным формы 0420503 Указания Банка России от 16.12.2015 N 3901-У.

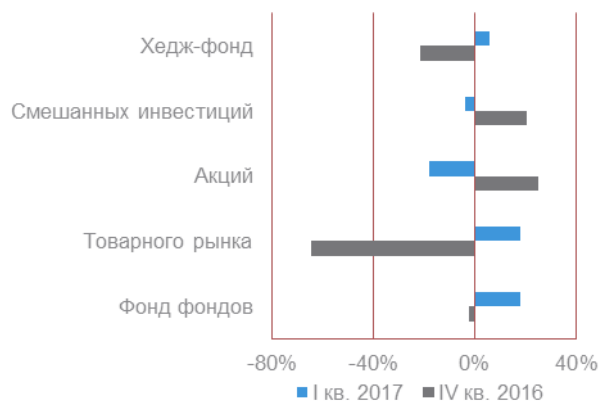
⁶ Выплата дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда) по данным формы 0420503 Указания Банка России от 16.12.2015 N 3901-У.

Рисунок 1.7

Доходность ЗПИФов (%)⁷

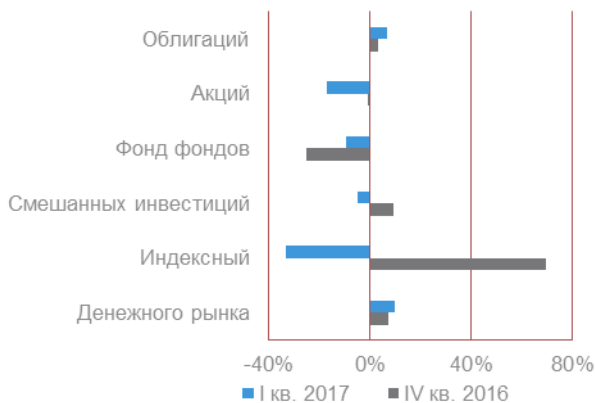
Источник: Банк России

Рисунок 1.9

Доходность ИПИФов (%)¹⁰

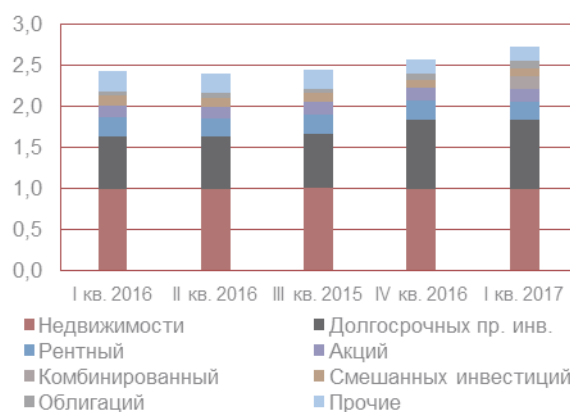
Источник: Банк России

Рисунок 1.8

Доходность ОПИФов (%)⁸

Источник: Банк России

Рисунок 1.10

Стоимость чистых активов по категориям ПИФов
(млрд рублей)

Источник: Банк России

Средневзвешенная доходность ПИФов в I квартале 2017 года составила 1,9% годовых, что почти в два раза ниже инфляции (3,7% годовых⁹). В то же время средневзвешенная доходность ЗПИФов – крупнейшего сектора по СЧА на рынке – достигла 2,2% годовых, а ИПИФов – наименьшего сектора – лишь 1,4% годовых. ОПИФы показали отрицательную доходность -3,3% годовых.

В связи с вступлением в силу в конце 2016 года Указания Банка России о составе и структуре активов АИФ и ПИФ¹¹ была введена новая градация фондов по категориям. Согласно Указанию вновь создаваемые фонды на рынке делятся, как и ранее, на два вида: для квалифицированных и неквалифицированных инвесторов. Но теперь к первым относятся категории фондов финансовых инструментов, недвижимости и комбинированных фондов, ко

⁷ Категории фондов указаны по убыванию доли СЧА в совокупной СЧА ЗПИФов на 31.03.2017.

⁸ Категории фондов указаны по убыванию доли СЧА в совокупной СЧА ОПИФов на 31.03.2017.

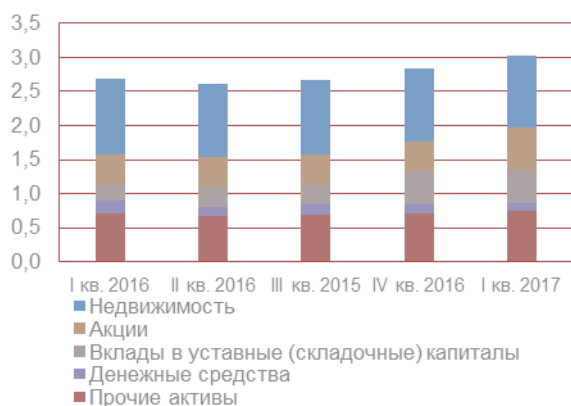
⁹ Рассчитано по данным Росстата http://www.gks.ru/free_doc/new_site/prices/potr/tab-potr1.htm

¹⁰ Категории фондов указаны по убыванию доли СЧА в совокупной СЧА ИПИФов на 31.03.2017.

¹¹ 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, было опубликовано 17.11.2016 http://www.cbr.ru/analytics/Default.aspx?PrtlID=na_vr&docid=157

Рисунок 1.11

Структура активов ПИФов (млрд рублей)



Источник: Банк России

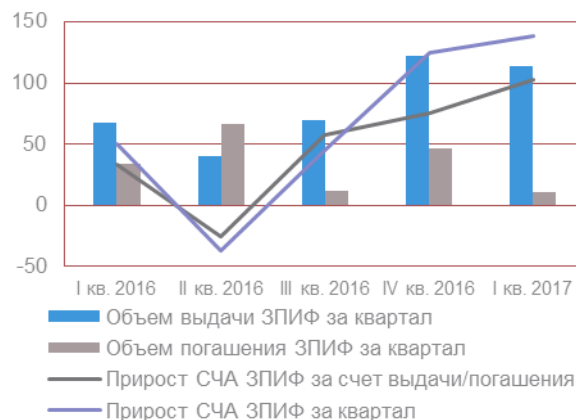
второму виду фондов – ПИФы рыночных финансовых инструментов и недвижимости. Существующие на момент вступления в силу Указания фонды должны быть приведены в соответствие новым требованиям в течение 1 года (ОПИФы), 3 лет (ИПИФы) или 10 лет (ЗПИФы). За I квартал 2017 года были зарегистрированы правила доверительного управления первых 18 вновь созданных комбинированных ЗПИФов под управлением 16 управляющих компаний. Отличительной чертой комбинированных фондов является возможность инвестирования в любой вид актива. Формирование этих фондов началось в конце I квартала 2017 года¹², поэтому их влияние на СЧА незначительно. Вместе с тем, 28 существующих ЗПИФов¹³ изменили свою категорию и стали комбинированными. В результате к концу марта СЧА комбинированных фондов достигла 152,2 млрд рублей, что составляло 5,9% от СЧА ЗПИФов и 5,6% от СЧА всех фондов. В то же время доля СЧА фондов недвижимости – крупнейшей по СЧА категории фондов на рынке – снизилась до 36,3% (-2,3 п.п. за квартал), доля фондов дол-

¹² Один фонд был исключен из реестра во II квартале 2017 года в связи с тем, что стоимость его имущества не была сформирована.

¹³ 12 фондов недвижимости, 10 долгосрочных прямых инвестиций, 2 кредитных, 1 акций, 1 особо рискованных (венчурных) инвестиций, 1 прямых инвестиций и 1 хедж-фонд.

Рисунок 1.12

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



Источник: Банк России

госрочных прямых инвестиций – до 31,2% (-1,4 п.п.), доля рентных фондов – до 8% (-1 п.п.).

Кроме того, в I квартале 2017 года существенно изменилась структура СЧА ПИФов. Так, доля акций выросла с 15,3 до 20,8% (+196,5 млрд рублей). Вместе с тем, доля крупнейшего направления инвестирования – недвижимости – уменьшилась на 3,1 п.п. до 34,8%, а доля вкладов в уставные капиталы – на 1,2 п.п. до 15,8%.

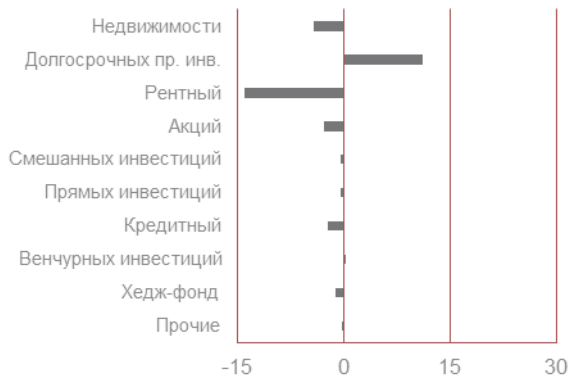
Закрытые паевые инвестиционные фонды

Несмотря на появление ЗПИФов новой категории, количество фондов этого типа уменьшилось с 1 150 до 1 131 за I квартал 2017 года.

В то же время доля СЧА закрытых фондов в структуре СЧА всех ПИФов практически не изменилась (-0,1 п.п.) и составила 94,1% на конец марта 2017 года. Однако СЧА ЗПИФов выросла на 5,7% (138,2 млрд рублей), до 2 569,1 млрд рублей. Нетто-приток инвестиций составил почти 103 млрд рублей (выдача паев на 114 млрд, погашение – на 11 млрд). Помимо этого, доход по имуществу достиг 24,5 млрд рублей, прирост стоимости имущества в результате сделок – 16,7 млрд рублей, прирост оценочной стоимости имущества – 11,8 млрд рублей. Размер выплат дохода по паям по итогам квартала превысил 14,3 млрд рублей.

Рисунок 1.13

Вклад отдельных категорий фондов в динамику СЧА ЗПИФов в I квартале 2017 года (млрд рублей)¹⁴



Источник: Банк России

Наибольшая в абсолютном значении динамика СЧА ЗПИФов наблюдалась в категории комбинированных фондов (+152,2 млрд рублей за квартал). Однако рост СЧА этих фондов в I квартале 2017 года вызван, в первую очередь, перетоком СЧА из других ЗПИФов за счет смены рядом фондов категорий на «комбинированные». Из ранее существовавших категорий фондов максимальный абсолютный прирост СЧА был зафиксирован в фондах долгосрочных прямых инвестиций (+11,1 млрд рублей), наибольшее сокращение в рентных фондах (-13,9 млрд рублей).

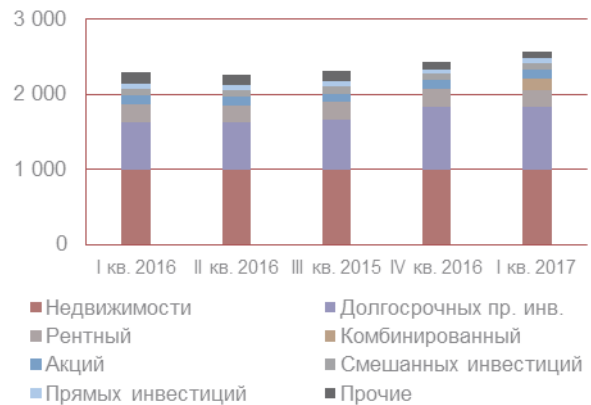
За первые три месяца 2017 года доля СЧА ЗПИФов недвижимости – крупнейшего сегмента в структуре ЗПИФов – уменьшилась на 2,4 п.п. до 38,5%. При этом сумма чистых активов этой категории фондов уменьшилась до 989,2 млрд рублей (-0,4%). Сокращение СЧА вызвано, в том числе, переходом 12 фондов в категорию комбинированных.

Несмотря на прирост СЧА ЗПИФов долгосрочных прямых инвестиций – второго по объему СЧА в структуре закрытых фондов – на

¹⁴ Категории фондов указаны по убыванию доли СЧА в совокупной СЧА ЗПИФов на 31.03.2017. В «Прочие» вошли 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.

Рисунок 1.14

Распределение СЧА ЗПИФов по категориям фондов (млрд рублей)



Источник: Банк России

11,1 млрд рублей (до 852,2 млрд) доля этой категории фондов уменьшилась на 1,4 п.п. (до 33,2%). Прирост СЧА наблюдался на фоне смены 10 фондами категории (стали комбинированными).

Доля рентных фондов – третьей по СЧА категории в структуре ЗПИФов – также уменьшилась в I квартале 2017 года и на конец марта составляла 8,5% (-1,1 п.п.). СЧА этих фондов уменьшилась на 13,9 млрд, до 217,6 млрд рублей. Основной причиной такой динамики стало значительное (почти на 15 млрд рублей) сокращение оценочной стоимости имущества¹⁵.

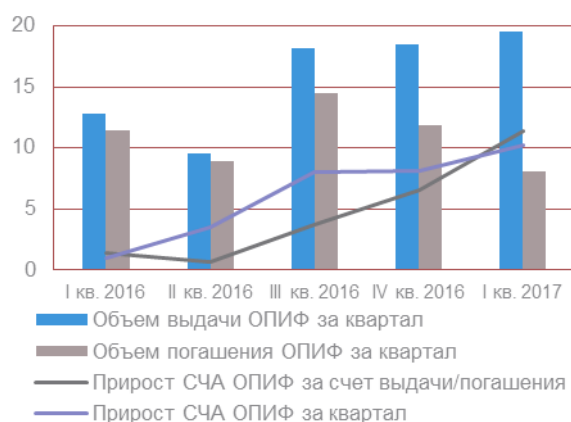
Открытые паевые инвестиционные фонды

В I квартале 2017 года количество открытых ПИФов сократилось на 18, до 338 на фоне роста СЧА этого типа фондов на 7,8% до 141,1 млрд рублей. Доля ОПИФов в СЧА всех фондов выросла на 0,1 п.п. до 5,2%. Нетто-приток инвестиций превысил 11,4 млрд рублей: объем выдачи составил 19,5 млрд рублей при объеме погашений – 8,1 млрд рублей. Доход

¹⁵ Прирост/уменьшение стоимости имущества в результате изменения оценочной стоимости имущества по данным формы 0420503 Указания Банка России от 16.12.2015 N 3901-У.

Рисунок 1.15

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



Источник: Банк России

по имуществу фондов достиг 1,9 млрд рублей, а сокращение оценочной стоимости имущества – 2,4 млрд рублей.

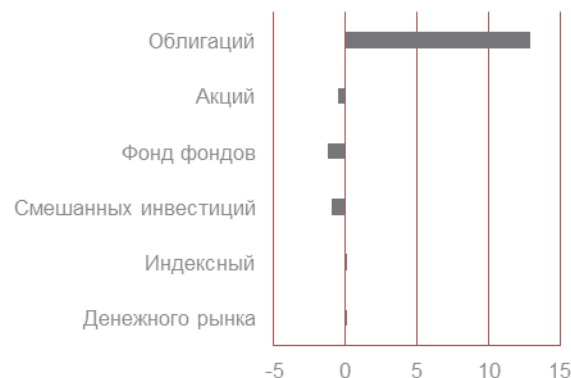
Существенный рост СЧА ОПИФов обеспечили фонды облигаций. За квартал их СЧА выросла на 12,9 млрд рублей. Сокращение СЧА ОПИФов фондов почти на 1,3 млрд рублей оказало наибольшее негативное влияние на динамику этого типа ПИФов. Изменение остальных категорий ОПИФов было в пределах 1 млрд рублей.

За прошедший квартал СЧА ОПИФов облигаций – крупнейшей категории открытых фондов – выросла на 19,2%, до 80,2 млрд рублей. Это привело к увеличению доли СЧА таких фондов в структуре всех ОПИФов до 56,9% (+5,4 п.п.). Основной рост обеспечил нетто-приток в размере 10,8 млрд рублей. Доход по имуществу фондов превысил 1,6 млрд рублей. Приток инвестиций был обеспечен, в том числе, высокой доходностью облигаций в 2016 году.

В I квартале 2017 года СЧА ОПИФов акций – второго по СЧА направления в секторе открытых фондов – уменьшилась на 1,4% до 35,5 млрд рублей, а доля СЧА этой категории фондов снизилась до 25,2% (27,5% на начало периода). Выдача паев за квартал превысила 3,6 млрд рублей, погашение – 2,1

Рисунок 1.16

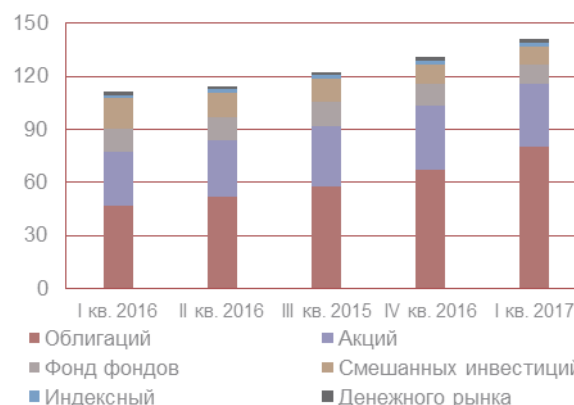
Вклад отдельных категорий фондов в динамику СЧА ОПИФов в I квартале 2017 года (млрд рублей)¹⁶



Источник: Банк России

Рисунок 1.17

Распределение СЧА ОПИФов по категориям фондов (млрд рублей)



Источник: Банк России

млрд рублей. Приток инвестиций наблюдался после существенного (+26,8%¹⁷) роста фондового рынка в 2016 году. При этом уменьшение оценочной стоимости имущества ОПИФов акций за I квартал 2017 года составило почти 1,6 млрд рублей на фоне снижения значения индекса ММББ (MICEXINDEXCF) на 10,6%¹⁸.

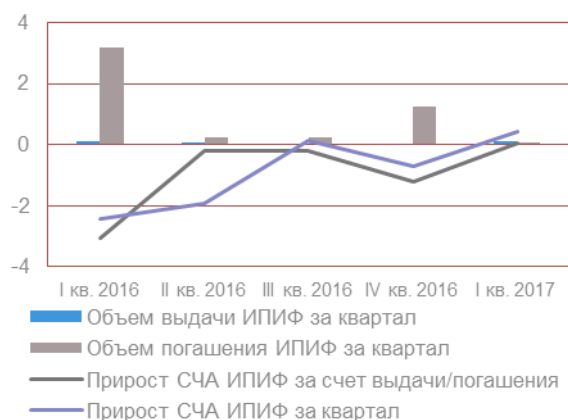
¹⁶ Категории фондов указаны по убыванию доли СЧА в совокупной СЧА ОПИФов на 31.03.2017.

¹⁷ Прирост индекса ММББ (MICEXINDEXCF).

¹⁸ <http://moex.com/ru/index/MICEXINDEXCF/archive/#/from=2017-01-01&till=2017-03-31&sort=TRADEDATE&order=desc>

Рисунок 1.18

Динамика СЧА, объемов выдачи и погашения инвестиционных паев ИПИФов (млрд рублей)



Источник: Банк России

Интервальные паевые инвестиционные фонды

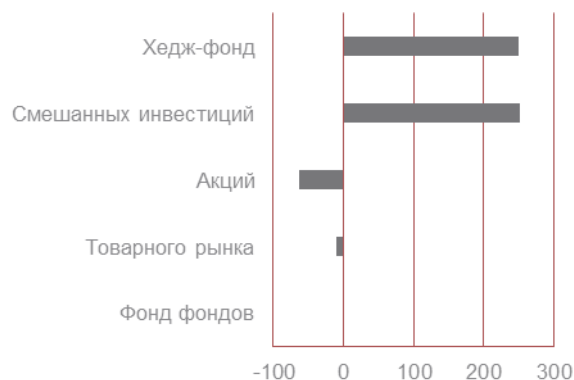
На конец марта 2017 года на рынке функционировало 43 ИПИФа (-4 с начала года). СЧА этих фондов превысила 18,5 млрд рублей (+2,4% за квартал). При этом доля СЧА ИПИФов в структуре СЧА всех фондов практически не изменилась за I квартал 2017 года и составила 0,7% на конец периода.

Прирост СЧА ИПИФов обеспечили крупнейшие категории фондов. Так, СЧА хедж-фондов (68,3% в структуре СЧА интервальных фондов) увеличилась на 250,2 млн рублей, СЧА фондов смешанных инвестиций (19,8% в структуре ИПИФов) – на 251,2 млн рублей. Сокращение СЧА было зафиксировано в ИПИФах акций (-63,4 млн рублей) и фондах товарного рынка (-9,4 млн рублей).

Несмотря на рост СЧА ИПИФов хедж-фондов на 2%, доля этой категории фондов в структуре всех интервальных фондов уменьшилась на 0,2 п.п. Нетто-приток инвестиций в интервальные хедж-фонды составил почти 68 млн рублей (объем выдачи паев превысил 70 млн рублей при объеме погашений в размере 2,3 млн рублей).

Рисунок 1.19

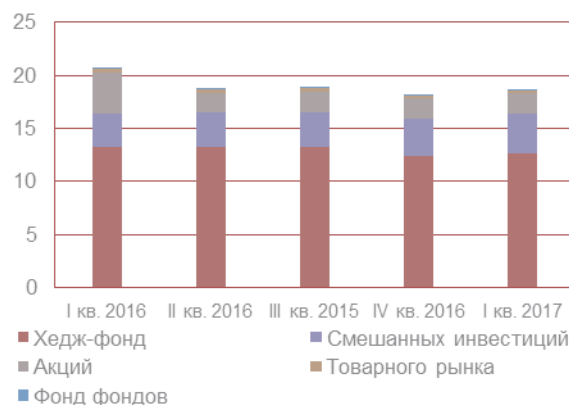
Вклад отдельных категорий фондов в динамику СЧА ИПИФов в I квартале 2017 года (млн рублей)¹⁹



Источник: Банк России

Рисунок 1.20

Распределение СЧА ИПИФов по категориям фондов (млрд рублей)



Источник: Банк России

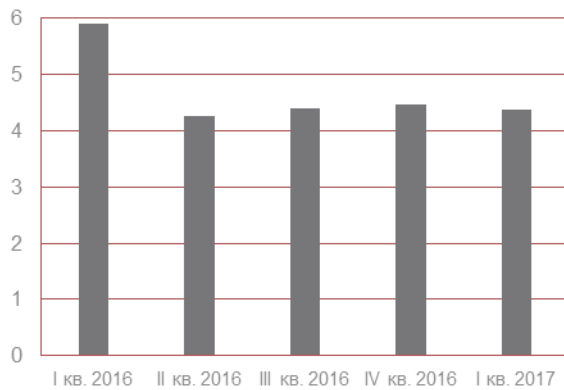
¹⁹ Категории фондов указаны по убыванию доли СЧА в совокупной СЧА ИПИФов на 31.03.2017.

2. АКЦИОНЕРНЫЕ ИНВЕСТИЦИОННЫЕ ФОНДЫ

СЧА трех АИФов, функционирующих на рынке, в I квартале 2017 года уменьшилась на 2,3% до 4,4 млрд рублей.

Рисунок 2.1

Динамика СЧА АИФов (млрд рублей)



Источник: Банк России

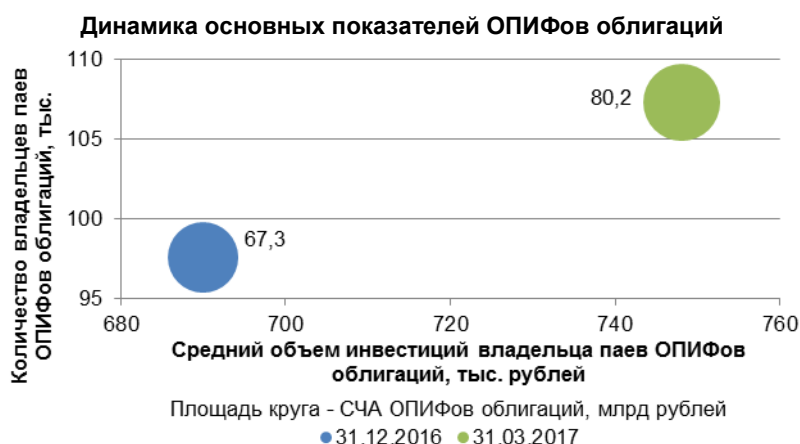
К концу I квартала 2017 года количество владельцев паев ОПИФов облигаций превысило 100 тыс.

За I квартал 2017 года СЧА ОПИФов облигаций увеличилась на 12,9 млрд рублей (до 80,2 млрд рублей). Это наилучший в абсолютном выражении результат среди открытых и интервальных фондов. На втором месте по размеру абсолютного прироста ИПИФы смешанных инвестиций (+251,2 млн рублей). Но доля этой категории среди всех открытых и интервальных фондов составляет лишь 2,3% в то время как доля ОПИФов облигаций – 50,3%. При этом сегмент ОПИФов облигаций отличается высокой концентрацией. При общем количестве фондов 71²⁰ основная часть активов приходится на треть фондов. Так, по итогам I квартала в топ-5 крупнейших фондах по СЧА было сконцентрировано 54,9% всей СЧА ОПИФов облигаций, в топ-20 – 93,5% (на конец 2016 года 56,7% и 93,3% соответственно).

Рост СЧА ОПИФов облигаций в начале года был обеспечен главным образом нетто-притоком инвестиций: выдача паев составила 14,1 млрд рублей при объеме погашений 3,3 млрд рублей. Причем приток средств был зафиксирован и за счет новых пайщиков. Так, за квартал количество владельцев паев ОПИФов облигаций увеличилось на 10% до 107,3 тыс., что составляет 7,4% от числа владельцев паев открытых и интервальных фондов и 28,4% от числа владельцев паев ОПИФов на конец марта 2017 года. Повышение интереса инвесторов к этой категории фондов объясняется доходностью облигаций, превосходящей ставки банковских депозитов. Так, за 2016 год значение индекса корпоративных облигаций (MICEXCBITR) выросло на 10,8%²¹, а доходность корпоративных облигаций в декабре 2016 года составила 10,3%²². В то же время средневзвешенная процентная ставка 30 крупнейших банков достигала 7,16% годовых для физических лиц и 8,88% для нефинансовых организаций²³.

Средний размер инвестиций владельца паев ОПИФов облигаций вырос в I квартале 2017 года с 690 до 748,1 тыс. рублей (+8,4%). Вместе с тем доходность фондов – изменение расчетной стоимости пая – за квартал варьируется от -6,66 до 11,34%²⁴ при росте значения индекса корпоративных облигаций ММВБ (MICEXCBITR)²⁵ на 3,1%.

Рисунок 1



Источник: Банк России

²⁰ В реестре на обе даты было 73 фонда, при этом 2 фонда уже прекратили действовать.

²¹ <http://moex.com/ru/index/MICEXCBITR/archive>

²² Значения индекса Cbonds-CBI RU 1-3Y YTM eff

²³ Ставка по депозитам в рублях сроком от 1 года до 3 лет по данным с сайта Банка России http://www.cbr.ru/statistics/?Prftd=int_rat

²⁴ По данным 70 ОПИФов облигаций

²⁵ <http://moex.com/ru/index/MICEXCBITR/archive>

3. КЛЮЧЕВЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ ПАЕВЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ И АКЦИОНЕРНЫХ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ФОНДОВ

| Наименование показателя | Единица измерения | 31.03.2016 | 30.06.2016 | 30.09.2016 | 31.12.2016 | 31.03.2017 | Изменение за квартал |
|---|-------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-------------|----------------------|
| Количество ПИФов зарегистрированных, не исключенных из реестра паевых инвестиционных фондов | ед. | 1 547 | 1 531 | 1 534 | 1 553 | 1 512 | - 2.64% |
| Закрытые ПИФ | ед. | 1 134 | 1 120 | 1 135 | 1 150 | 1 131 | - 1.65% |
| Открытые ПИФ | ед. | 364 | 362 | 353 | 356 | 338 | - 5.06% |
| Интервальные ПИФ | ед. | 49 | 49 | 46 | 47 | 43 | - 8.51% |
| Количество специализированных депозитариев, контролирующих ПИФ (согласно сданной отчетности) | ед. | 30 | 28 | 30 | 30 | 30 | 0.00% |
| Количество управляющих компаний, осуществляющих Д.У. ПИФ (согласно сданной отчетности) | ед. | 321 | 314 | 308 | 301 | 292 | - 2.99% |
| Количество владельцев акций (паев) (согласно сданной отчетности) | тыс.ед. | 1 457.6 | 1 458.5 | 1 463.3 | 1 466.0 | 1 467.9 | 0.13% |
| Закрытые ПИФ | тыс.ед. | 9.0 | 10.2 | 9.8 | 10.2 | 10.1 | - 0.95% |
| Открытые ПИФ | тыс.ед. | 342.7 | 368.3 | 373.6 | 376.0 | 378.1 | 0.56% |
| Интервальные ПИФ | тыс.ед. | 1 105.9 | 1 080.1 | 1 080.0 | 1 079.7 | 1 079.6 | - 0.01% |
| Количество ПИФов для квалифицированных инвесторов, завершивших формирование (в том числе в стадии прекращения): | ед. | 747 | 748 | 743 | 756 | 763 | 0.93% |
| Концентрация | | | | | | | |
| количество ПИФ, составляющих 80 % активов | ед. | 217 | 210 | 209 | 188 | 176 | - 6.38% |
| доля ПИФ, составляющих 80 % активов | % | 15.4 | 15.4 | 15.0 | 12.8 | 12.7 | - 0.10 п.п. |
| количество УК совместно контролирующих 80 % активов | ед. | 71 | 68 | 66 | 61 | 58 | - 4.92% |
| количество УК совместно контролирующих 80 % активов | % | 22.1 | 21.7 | 19.5 | 20.3 | 19.9 | - 0.44 п.п. |
| количество спецдепозитариев совместно контролирующих 80 % активов | ед. | 7 | 5 | 5 | 5 | 5 | 0.00% |
| количество спецдепозитариев совместно контролирующих 80 % активов | % | 23.3 | 17.9 | 16.7 | 16.7 | 16.7 | 0.00 п.п. |
| top-20 ПИФ по СЧА | % | 34.6 | 35.2 | 34.9 | 39.8 | 41.5 | 1.74 п.п. |
| top-20 ПИФ по количеству участников - физических лиц**** | % | 80.8 | 86.2 | 86.0 | 86.1 | 86.2 | 0.17 п.п. |
| top-20 УК по СЧА | % | 49.6 | 51.3 | 51.3 | 55.1 | 56.1 | 1.04 п.п. |
| top-100 ПИФ по СЧА | % | 63.4 | 64.9 | 65.0 | 67.8 | 69.1 | 1.39 п.п. |
| top-100 ПИФ по количеству участников - физических лиц | % | 97.0 | 97.2 | 97.2 | 97.3 | 97.5 | 0.21 п.п. |
| top-100 УК по СЧА | % | 87.7 | 88.2 | 88.6 | 89.8 | 90.3 | 0.46 п.п. |
| Активы | млн руб. | 2 680 200.6 | 2 618 125.1 | 2 675 068.3 | 2 835 195.3 | 3 033 530.0 | 7.00% |
| Отношение активов к ВВП | % | 3.3 | 3.2 | 3.2 | 3.3 | 3.5 | 0.22 п.п. |
| Стоимость чистых активов - СЧА | млн руб. | 2 430 168.9 | 2 394 961.4 | 2 447 828.0 | 2 579 909.8 | 2 728 774.1 | 5.77% |
| СЧА ПИФ для квалифицированных инвесторов | млн руб. | 1 824 534.9 | 1 801 631.3 | 1 821 003.3 | 1 958 754.1 | 2 110 982.2 | 7.77% |
| Обязательства по основному виду деятельности | млн руб. | 250 031.7 | 223 163.7 | 227 240.2 | 255 285.6 | 304 756.0 | 19.38% |
| Количество действующих АИФ | шт. | 4 | 3 | 3 | 3 | 3 | 0.00% |
| СЧА АИФ | млн руб. | 5 902.3 | 4 266.6 | 4 410.9 | 4 477.2 | 4 372.5 | - 2.34% |

| Наименование показателя | Единица измерения | 31.03.2016 | 30.06.2016 | 30.09.2016 | 31.12.2016 | 31.03.2017 | Изменение за квартал |
|--|-------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|----------------------|
| Активы, в том числе | млн руб. | 2 680 200.6 | 2 618 125.1 | 2 675 068.3 | 2 835 195.3 | 3 033 530.0 | 7.00% |
| Денежные средства в том числе | млн руб. | 238 436.6 | 190 293.0 | 208 412.0 | 194 188.3 | 181 345.4 | - 6.61% |
| на текущих счетах | млн руб. | 185 455.3 | 140 402.7 | 144 656.4 | 134 935.9 | 120 751.8 | - 10.51% |
| на депозитах | млн руб. | 52 981.3 | 49 890.3 | 63 755.6 | 59 252.4 | 60 593.6 | 2.26% |
| Акции российских эмитентов (обыкновенные + привилегированные) | млн руб. | 426 214.1 | 427 367.9 | 432 749.9 | 434 030.0 | 630 524.5 | 45.27% |
| Облигации российских эмитентов | млн руб. | 58 844.1 | 54 001.8 | 62 919.4 | 82 574.8 | 95 250.4 | 15.35% |
| Государственные ценные бумаги | млн руб. | 10 158.7 | 8 904.8 | 10 625.3 | 12 895.9 | 15 736.7 | 22.03% |
| Ценные бумаги субъектов РФ | млн руб. | 2 562.5 | 2 083.4 | 4 272.7 | 3 053.0 | 2 942.0 | - 3.63% |
| Муниципальные ценные бумаги | млн руб. | 58.8 | 30.6 | 25.3 | 28.5 | 26.2 | - 8.06% |
| Иностранные ценные бумаги | млн руб. | 115 627.9 | 111 399.5 | 116 587.0 | 100 321.2 | 92 636.2 | - 7.66% |
| Инвестиционные паи ПИФ | млн руб. | 4 134.7 | 4 323.1 | 4 229.4 | 5 309.1 | 6 343.0 | 19.47% |
| Вклады в уставные (складочные) капиталы российских организаций | млн руб. | 247 181.1 | 294 987.3 | 309 131.5 | 484 029.8 | 480 545.0 | - 0.72% |
| Векселя других организаций | млн руб. | 81 102.6 | 77 600.9 | 76 095.2 | 73 079.7 | 67 439.8 | - 7.72% |
| Недвижимость, ипотечные ценные бумаги и закладные | млн руб. | 1 117 976.7 | 1 095 343.6 | 1 108 414.8 | 1 073 427.7 | 1 054 591.7 | - 1.75% |
| недвижимость | млн руб. | 1 107 162.6 | 1 085 354.3 | 1 099 061.4 | 1 072 637.9 | 1 054 178.9 | - 1.72% |
| ипотечные ценные бумаги и закладные | млн руб. | 10 814.1 | 9 989.3 | 9 353.4 | 789.8 | 412.9 | - 47.73% |
| Прочие активы | млн руб. | 377 902.9 | 351 789.3 | 341 605.8 | 372 257.5 | 406 149.1 | 9.10% |
| Активы ЗПИФов, в том числе | млн руб. | 2 546 527.2 | 2 483 047.1 | 2 531 435.3 | 2 684 434.7 | 2 871 965.6 | 6.99% |
| Денежные средства в том числе | млн руб. | 232 263.4 | 184 405.3 | 202 970.3 | 188 468.3 | 174 835.7 | - 7.23% |
| на текущих счетах | млн руб. | 182 021.5 | 137 480.6 | 141 684.9 | 131 341.2 | 116 461.2 | - 11.33% |
| на депозитах | млн руб. | 50 242.0 | 46 924.7 | 61 285.4 | 57 127.0 | 58 374.5 | 2.18% |
| Акции российских эмитентов (обыкновенные + привилегированные) | млн руб. | 397 303.7 | 397 407.4 | 399 551.1 | 396 312.1 | 592 934.3 | 49.61% |
| Облигации российских эмитентов | млн руб. | 27 024.1 | 17 602.4 | 21 781.1 | 34 499.4 | 37 949.7 | 10.00% |
| Государственные ценные бумаги | млн руб. | 779.4 | 946.3 | 2 043.2 | 1 735.6 | 1 699.2 | - 2.10% |
| Ценные бумаги субъектов РФ | млн руб. | 101.8 | 57.1 | 2 542.9 | 58.6 | 57.6 | - 1.85% |
| Муниципальные ценные бумаги | млн руб. | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.00% |
| Иностранные ценные бумаги | млн руб. | 67 553.1 | 65 880.6 | 70 119.8 | 60 987.8 | 55 424.8 | - 9.12% |
| Инвестиционные паи ПИФ | млн руб. | 4 096.2 | 4 279.5 | 4 178.1 | 5 255.7 | 6 293.0 | 19.74% |
| Вклады в уставные (складочные) капиталы российских организаций | млн руб. | 247 181.1 | 294 987.3 | 309 131.5 | 484 029.8 | 480 545.0 | - 0.72% |
| Векселя других организаций | млн руб. | 81 102.6 | 77 600.9 | 76 095.2 | 73 079.7 | 67 439.8 | - 7.72% |
| Недвижимость, ипотечные ценные бумаги и закладные, в том числе | млн руб. | 1 117 976.7 | 1 095 343.6 | 1 108 414.8 | 1 073 427.7 | 1 054 591.7 | - 1.75% |
| недвижимость | млн руб. | 1 107 162.6 | 1 085 354.3 | 1 099 061.4 | 1 072 637.9 | 1 054 178.9 | - 1.72% |
| ипотечные ценные бумаги и закладные | млн руб. | 10 814.1 | 9 989.3 | 9 353.4 | 789.8 | 412.9 | - 47.73% |
| Прочие активы | млн руб. | 371 145.2 | 344 536.8 | 334 607.4 | 366 580.0 | 400 194.8 | 9.17% |
| Активы ИПИФов, в том числе | млн руб. | 21 142.4 | 19 076.1 | 19 142.2 | 18 406.3 | 18 951.5 | 2.96% |
| Денежные средства в том числе | млн руб. | 844.2 | 843.8 | 1 142.5 | 910.9 | 1 402.8 | 54.00% |

| Наименование показателя | Единица измерения | 31.03.2016 | 30.06.2016 | 30.09.2016 | 31.12.2016 | 31.03.2017 | Изменение за квартал |
|--|-------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------------------|----------------------|
| на текущих счетах | млн руб. | 299.2 | 143.8 | 395.0 | 140.3 | 496.1 | 253.76% |
| на депозитах | млн руб. | 545.0 | 700.0 | 747.5 | 770.6 | 906.6 | 17.64% |
| Акции российских эмитентов (обыкновенные + привилегированные) | млн руб. | 8 184.7 | 7 322.7 | 7 408.1 | 8 180.4 | 7 892.0 | - 3.53% |
| Облигации российских эмитентов | млн руб. | 4 904.0 | 5 028.3 | 2 761.6 | 5 028.8 | 5 216.1 | 3.73% |
| Государственные ценные бумаги | млн руб. | 321.5 | 320.7 | 105.7 | 188.5 | 239.1 | 26.81% |
| Ценные бумаги субъектов РФ | млн руб. | 246.7 | 111.0 | 183.2 | 23.8 | 64.0 | 168.79% |
| Муниципальные ценные бумаги | млн руб. | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.00% |
| Иностранные ценные бумаги | млн руб. | 5 175.4 | 4 354.4 | 6 108.1 | 3 046.4 | 3 084.3 | 1.25% |
| Инвестиционные паи ПИФ | млн руб. | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.00% |
| Вклады в уставные (складочные) капиталы российских организаций | млн руб. | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.00% |
| Векселя других организаций | млн руб. | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.00% |
| Недвижимость, ипотечные ценные бумаги и закладные, в том числе | млн руб. | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.00% |
| недвижимость | млн руб. | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.00% |
| ипотечные ценные бумаги и закладные | млн руб. | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.00% |
| Прочие активы | млн руб. | 1 465.9 | 1 095.2 | 1 433.0 | 1 027.4 | 1 053.2 | 2.51% |
| Активы ОПИФов, в том числе | млн руб. | 112 531.0 | 116 001.9 | 124 490.8 | 132 354.3 | 142 612.9 | 7.75% |
| Денежные средства в том числе | млн руб. | 5 328.9 | 5 043.9 | 4 299.3 | 4 809.1 | 5 107.0 | 6.19% |
| на текущих счетах | млн руб. | 3 134.6 | 2 778.3 | 2 576.5 | 3 454.4 | 3 794.5 | 9.84% |
| на депозитах | млн руб. | 2 194.3 | 2 265.6 | 1 722.8 | 1 354.7 | 1 312.5 | - 3.11% |
| Акции российских эмитентов (обыкновенные + привилегированные) | млн руб. | 20 725.7 | 22 637.8 | 25 790.7 | 29 537.5 | 29 698.2 | 0.54% |
| Облигации российских эмитентов | млн руб. | 26 916.0 | 31 371.1 | 38 376.8 | 43 046.6 | 52 084.5 | 21.00% |
| Государственные ценные бумаги | млн руб. | 9 057.9 | 7 637.8 | 8 476.4 | 10 971.8 | 13 798.4 | 25.76% |
| Ценные бумаги субъектов РФ | млн руб. | 2 213.9 | 1 915.3 | 1 546.6 | 2 970.5 | 2 820.5 | - 5.05% |
| Муниципальные ценные бумаги | млн руб. | 58.8 | 30.6 | 25.3 | 28.5 | 26.2 | - 8.06% |
| Иностранные ценные бумаги | млн руб. | 42 899.4 | 41 164.5 | 40 359.2 | 36 287.0 | 34 127.1 | - 5.95% |
| Инвестиционные паи ПИФ | млн руб. | 38.5 | 43.6 | 51.2 | 53.3 | 49.9 | - 6.41% |
| Вклады в уставные (складочные) капиталы российских организаций | млн руб. | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.00% |
| Векселя других организаций | млн руб. | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.00% |
| Недвижимость, ипотечные ценные бумаги и закладные, в том числе | млн руб. | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.00% |
| недвижимость | млн руб. | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.00% |
| ипотечные ценные бумаги и закладные | млн руб. | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.00% |
| Прочие активы | млн руб. | 5 291.9 | 6 157.2 | 5 565.4 | 4 650.0 | 4 901.1 | 5.40% |
| Стоимость чистых активов (СЧА), том числе | млн руб. | 2 430 168.9 | 2 394 961.4 | 2 447 828.0 | 2 579 909.8 | 2 728 774.1 | 5.77% |
| Закрытые ПИФ, том числе | млн руб. | 2 298 389.8 | 2 261 602.5 | 2 306 345.0 | 2 430 956.0 | 2 569 124.2 | 5.68% |
| акций | млн руб. | 109 888.2 | 110 091.6 | 114 630.2 | 120 330.0 | 117 545.1 | - 2.31% |
| денежного рынка | млн руб. | 581.2 | 593.1 | 1 082.6 | 1 104.1 | 1 132.8 | 2.61% |

| Наименование показателя | Единица измерения | 31.03.2016 | 30.06.2016 | 30.09.2016 | 31.12.2016 | 31.03.2017 | Изменение за квартал |
|--|-------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|----------------------|
| долгосрочных прямых инвестиций | млн руб. | 644 205.2 | 633 227.6 | 663 286.2 | 841 071.0 | 852 166.0 | 1.32% |
| ипотечный | млн руб. | 12 446.6 | 11 879.2 | 11 491.3 | 1 654.5 | 1 428.6 | - 13.65% |
| комбинированный | | | | | | 152 197.6 | х |
| кредитный | млн руб. | 59 570.7 | 49 937.8 | 51 608.2 | 44 957.2 | 42 674.5 | - 5.08% |
| недвижимости | млн руб. | 990 814.3 | 996 693.6 | 1 003 882.7 | 993 529.1 | 989 238.7 | - 0.43% |
| облигаций | млн руб. | 0.0 | 1 499.0 | 1 477.2 | 1 456.7 | 1 556.3 | 6.83% |
| особо рискованных (венчурных) инвестиций | млн руб. | 43 520.5 | 35 118.3 | 32 067.7 | 28 094.2 | 28 388.4 | 1.05% |
| прямых инвестиций | млн руб. | 66 730.5 | 65 760.1 | 63 413.0 | 61 186.3 | 60 853.4 | - 0.54% |
| рентный | млн руб. | 236 314.9 | 228 260.5 | 231 814.3 | 231 522.6 | 217 575.4 | - 6.02% |
| смешанных инвестиций | млн руб. | 92 080.1 | 92 374.1 | 94 501.2 | 90 944.2 | 90 459.2 | - 0.53% |
| хедж-фонд | млн руб. | 42 046.1 | 35 989.2 | 36 863.8 | 14 923.5 | 13 862.4 | - 7.11% |
| художественных ценностей | млн руб. | 191.4 | 178.4 | 177.0 | 140.5 | х | х |
| товарного рынка | млн руб. | 0.0 | 0.0 | 49.6 | 42.0 | 45.8 | 9.00% |
| Открытые ПИФ, том числе | млн руб. | 111 113.1 | 114 640.5 | 122 643.8 | 130 805.2 | 141 072.1 | 7.85% |
| акций | млн руб. | 30 406.5 | 31 743.7 | 34 008.8 | 36 012.6 | 35 525.2 | - 1.35% |
| денежного рынка | млн руб. | 1 632.5 | 1 730.7 | 1 723.7 | 1 697.2 | 1 706.1 | 0.52% |
| индексный | млн руб. | 1 969.2 | 1 934.5 | 2 049.1 | 2 414.2 | 2 442.1 | 1.16% |
| облигаций | млн руб. | 46 654.9 | 51 825.6 | 58 016.7 | 67 314.1 | 80 246.6 | 19.21% |
| смешанных инвестиций | млн руб. | 17 053.0 | 14 190.4 | 13 280.4 | 11 199.7 | 10 246.7 | - 8.51% |
| фонд фондов | млн руб. | 13 397.0 | 13 215.6 | 13 565.1 | 12 167.3 | 10 905.4 | - 10.37% |
| Интервальные ПИФ, том числе | млн руб. | 20 666.1 | 18 718.4 | 18 839.3 | 18 148.5 | 18 577.8 | 2.37% |
| акций | млн руб. | 3 928.7 | 1 901.1 | 1 978.4 | 2 027.2 | 1 963.8 | - 3.13% |
| смешанных инвестиций | млн руб. | 3 163.4 | 3 193.7 | 3 272.6 | 3 422.8 | 3 674.0 | 7.34% |
| товарного рынка | млн руб. | 360.2 | 325.3 | 332.5 | 249.5 | 240.1 | - 3.76% |
| фонд фондов | млн руб. | 23.0 | 15.9 | 16.2 | 16.1 | 16.8 | 4.29% |
| хедж-фонд | млн руб. | 13 190.7 | 13 282.4 | 13 239.5 | 12 432.9 | 12 683.0 | 2.01% |
| Средневзвешенная доходность (изменение стоимости пая) с начала года | % | 0.6 | 0.8 | 0.8 | 2.2 | 0.5 | - 1.71 п.п. |
| Закрытые ПИФ | % | 0.7 | 0.8 | 0.62 | 2.0 | 0.5 | - 1.42 п.п. |
| акций | % | 2.7 | 2.8 | 7.4 | 12.8 | -0.9 | - 13.70 п.п. |
| денежного рынка | % | 2.6 | 4.7 | -12.3 | -10.6 | 2.6 | 13.16 п.п. |
| долгосрочных прямых инвестиций | % | 3.0 | 6.0 | 6.0 | 12.1 | 2.0 | - 10.01 п.п. |
| ипотечный | % | 2.7 | 2.2 | 1.9 | -9.5 | -5.7 | 3.83 п.п. |
| комбинированный | % | | | | | 8.1 | х |
| кредитный | % | -1.3 | -9.0 | -7.3 | -19.4 | -3.9 | 15.50 п.п. |
| недвижимости | % | -1.4 | -1.3 | -2.3 | -1.8 | 1.2 | 3.09 п.п. |

| Наименование показателя | Единица измерения | 31.03.2016 | 30.06.2016 | 30.09.2016 | 31.12.2016 | 31.03.2017 | Изменение за квартал |
|---|-------------------|------------|------------|------------|------------|------------|----------------------|
| облигаций | % | 0.0 | 4.6 | 3.1 | 1.6 | 6.8 | 5.19 п.п. |
| особо рискованных (венчурных) инвестиций | % | 3.4 | -0.2 | -5.4 | -11.9 | -0.4 | 11.49 п.п. |
| прямых инвестиций | % | -3.2 | -4.4 | -7.2 | -10.4 | -0.5 | 9.83 п.п. |
| рентный | % | 0.4 | -2.0 | -2.4 | -2.2 | -6.1 | -3.84 п.п. |
| смешанных инвестиций | % | 3.4 | 4.4 | 6.1 | 4.7 | 0.3 | -4.42 п.п. |
| хедж-фонд | % | 10.0 | 3.0 | 5.8 | -8.4 | -7.1 | 1.33 п.п. |
| художественных ценностей | % | 3.1 | -3.8 | -4.9 | -24.5 | х | х |
| товарного рынка | % | | | | | 9.0 | х |
| Открытые ПИФ | % | -0.6 | 0.3 | 4.1 | 5.5 | -0.8 | -6.29 п.п. |
| акций | % | 1.9 | 3.9 | 11.7 | 18.0 | -4.5 | -22.54 п.п. |
| денежного рынка | % | 2.6 | 4.9 | 7.3 | 9.6 | 2.4 | -7.28 п.п. |
| индексный | % | 7.5 | 10.2 | 18.8 | 35.3 | -9.5 | -44.80 п.п. |
| облигаций | % | 1.1 | 3.1 | 5.1 | 5.4 | 1.7 | -3.62 п.п. |
| смешанных инвестиций | % | 0.0 | -0.5 | 2.5 | 4.0 | -1.3 | -5.27 п.п. |
| фонд фондов | % | -11.1 | -14.0 | -12.5 | -18.4 | -2.4 | 16.02 п.п. |
| Интервальные ПИФ | % | 2.7 | 4.0 | 5.6 | 7.6 | 0.3 | -7.26 п.п. |
| акций | % | 5.5 | 7.0 | 13.4 | 22.2 | -4.8 | -27.01 п.п. |
| смешанных инвестиций | % | 5.6 | 7.4 | 11.8 | 17.7 | -1.0 | -18.67 п.п. |
| товарного рынка | % | 2.7 | -1.3 | 3.6 | -12.9 | 4.3 | 17.11 п.п. |
| фонд фондов | % | 0.2 | -0.7 | 1.2 | 1.1 | 4.3 | 3.18 п.п. |
| хедж-фонд | % | 1.5 | 3.1 | 3.6 | 4.4 | 1.5 | -2.93 п.п. |
| Средневзвешенная доходность (изменение стоимости пая) за прошедший квартал | % | х | х | -0.3 | -0.7 | 0.5 | 1.15 п.п. |
| Закрытые ПИФ | % | х | х | -0.53 | -0.7 | 0.5 | 1.25 п.п. |
| акций | % | х | х | 4.1 | 5.0 | -0.9 | -5.92 п.п. |
| денежного рынка | % | х | х | 2.0 | 2.0 | 2.6 | 0.62 п.п. |
| долгосрочных прямых инвестиций | % | х | х | 0.9 | 4.3 | 2.0 | -2.23 п.п. |
| ипотечный | % | х | х | -0.3 | -84.0 | -5.7 | 78.31 п.п. |
| комбинированный | % | | | | | 8.1 | х |
| кредитный | % | х | х | 1.5 | -12.0 | -3.9 | 8.12 п.п. |
| недвижимости | % | х | х | -2.1 | -0.6 | 1.2 | 1.81 п.п. |
| облигаций | % | х | х | -1.5 | -1.4 | 6.8 | 8.22 п.п. |
| особо рискованных (венчурных) инвестиций | % | х | х | -5.2 | -7.3 | -0.4 | 6.94 п.п. |
| прямых инвестиций | % | х | х | -3.0 | -3.5 | -0.5 | 2.97 п.п. |
| рентный | % | х | х | -0.5 | -0.1 | -6.1 | -5.94 п.п. |
| смешанных инвестиций | % | х | х | 2.3 | -3.6 | 0.3 | 3.84 п.п. |

| Наименование показателя | Единица измерения | 31.03.2016 | 30.06.2016 | 30.09.2016 | 31.12.2016 | 31.03.2017 | Изменение за квартал |
|---|-------------------|-------------|--------------|-------------|--------------|--------------|----------------------|
| хедж-фонд | % | х | х | 2.1 | -59.2 | -7.1 | 52.10 п.п. |
| художественных ценностей | % | х | х | -1.1 | -20.6 | х | 20.62 п.п. |
| товарного рынка | % | х | х | 0.0 | -15.4 | 9.0 | 24.38 п.п. |
| Открытые ПИФ | % | х | х | 3.83 | 0.13 | -0.8 | - 0.95 п.п. |
| акций | % | х | х | 7.6 | -0.1 | -4.5 | - 4.41 п.п. |
| денежного рынка | % | х | х | 2.3 | 1.8 | 2.4 | 0.56 п.п. |
| индексный | % | х | х | 7.9 | 14.1 | -9.5 | - 23.65 п.п. |
| облигаций | % | х | х | 2.0 | 0.9 | 1.7 | 0.87 п.п. |
| смешанных инвестиций | % | х | х | 3.3 | 2.2 | -1.3 | - 3.49 п.п. |
| фонд фондов | % | х | х | 2.1 | -7.0 | -2.4 | 4.64 п.п. |
| Интервальные ПИФ | % | х | х | 1.97 | -3.13 | 0.3 | 3.47 п.п. |
| акций | % | х | х | 6.1 | 5.7 | -4.8 | - 10.50 п.п. |
| смешанных инвестиций | % | х | х | 4.1 | 4.8 | -1.0 | - 5.72 п.п. |
| товарного рынка | % | х | х | 4.7 | -22.9 | 4.3 | 27.13 п.п. |
| фонд фондов | % | х | х | 2.0 | -0.6 | 4.3 | 4.85 п.п. |
| хедж-фонд | % | х | х | 0.8 | -5.9 | 1.5 | 7.40 п.п. |
| Выдача и погашение инвестиционных паев ПИФ с начала года | млрд руб. | 31.6 | 6.2 | 67.3 | 148.0 | 114.5 | - 22.67 % |
| Закрытые ПИФ | млрд руб. | 33.3 | 7.4 | 65.0 | 140.4 | 103.0 | - 26.62 % |
| Объем выдачи ЗПИФ с начала года | млрд руб. | 67.0 | 107.1 | 176.1 | 298.0 | 114.0 | - 61.76 % |
| Объем погашения ЗПИФ с начала года | млрд руб. | 33.6 | 99.7 | 111.1 | 157.7 | 11.0 | - 93.04 % |
| Открытые ПИФ | млрд руб. | 1.4 | 2.0 | 5.8 | 12.3 | 11.4 | - 7.21 % |
| Объем выдачи ОПИФ с начала года | млрд руб. | 12.8 | 22.3 | 40.5 | 58.9 | 19.5 | - 66.89 % |
| Объем погашения ОПИФ с начала года | млрд руб. | 11.4 | 20.3 | 34.7 | 46.6 | 8.1 | - 82.67 % |
| Интервальные ПИФ | млрд руб. | -3.1 | -3.2 | -3.4 | -4.7 | 0.0 | - 100.99 % |
| Объем выдачи ИПИФ с начала года | млрд руб. | 0.1 | 0.2 | 0.2 | 0.2 | 0.1 | - 52.40 % |
| Объем погашения ИПИФ с начала года | млрд руб. | 3.2 | 3.4 | 3.6 | 4.9 | 0.1 | - 98.59 % |
| Выдача и погашение инвестиционных паев ПИФ за квартал | млрд руб. | 31.6 | -25.5 | 61.2 | 80.7 | 114.5 | 41.89 % |
| Закрытые ПИФ | млрд руб. | 33.3 | -26.0 | 57.6 | 75.4 | 103.0 | 36.65 % |
| Объем выдачи ЗПИФ за квартал | млрд руб. | 67.0 | 40.1 | 69.0 | 121.9 | 114.0 | - 6.53 % |
| Объем погашения ЗПИФ за квартал | млрд руб. | 33.6 | 66.1 | 11.4 | 46.6 | 11.0 | - 76.43 % |
| Открытые ПИФ | млрд руб. | 1.4 | 0.7 | 3.8 | 6.5 | 11.4 | 74.79 % |
| Объем выдачи ОПИФ за квартал | млрд руб. | 12.8 | 9.5 | 18.2 | 18.4 | 19.5 | 5.84 % |
| Объем погашения ОПИФ за квартал | млрд руб. | 11.4 | 8.9 | 14.4 | 11.9 | 8.1 | - 32.10 % |
| Интервальные ПИФ | млрд руб. | -3.1 | -0.2 | -0.2 | -1.2 | 0.0 | - 103.76 % |
| Объем выдачи ИПИФ за квартал | млрд руб. | 0.1 | 0.1 | 0.0 | 0.0 | 0.1 | 309.18 % |
| Объем погашения ИПИФ за квартал | млрд руб. | 3.2 | 0.2 | 0.2 | 1.3 | 0.1 | - 94.54 % |

| Млрд руб., на основе отчетности, присланной в I квартале 2017 года | 01 Прирост (+) (уменьшение (-)) стоимости имущества в результате сделок с имуществом - всего | 02 Прирост (+) (уменьшение (-)) стоимости имущества в результате изменения оценочной стоимости имущества - всего | 03 Прирост (+) (уменьшение (-)) средств в иностранной валюте | 04 Доход по имуществу, принадлежащему акционерному фонду (составляющему паевой инвестиционный фонд) - всего | 05 Оплата по договорам, в том числе по договорам аренды, права из которых составляют имущество фонда | 06 Оплата вознаграждений управляющей компании, специализированному депозитарию, лицу, осуществляющему ведение реестра, аудиторской организации, оценщику и бирже - всего | 07 Оплата расходов, связанных с управлением акционерным фондом или доверительным управлением паевым инвестиционным фондом |
|--|--|--|--|---|--|--|---|
| Закрытые ПИФ, том числе | 16.7 | 11.8 | -1.8 | 24.5 | 0.4 | 4.5 | 5.6 |
| акций | 0.0 | -1.1 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.1 | 0.0 |
| денежного рынка | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| долгосрочных прямых инвестиций | 9.6 | 6.1 | -1.6 | 5.9 | 0.0 | 1.4 | 0.0 |
| ипотечный | 0.0 | -0.1 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| комбинированный | 1.8 | 21.4 | 0.1 | 0.9 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| кредитный | -0.3 | -3.1 | 0.0 | 0.9 | 0.0 | 0.1 | 0.0 |
| недвижимости | 10.6 | 0.9 | -0.1 | 14.2 | 0.4 | 2.3 | 5.2 |
| облигаций | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| особо рискованных (венчурных) инвестиций | 0.3 | -1.0 | -0.1 | 0.8 | 0.0 | 0.1 | 0.0 |
| прямых инвестиций | 0.0 | -0.4 | 0.0 | 0.6 | 0.0 | 0.1 | 0.0 |
| рентный | 0.0 | -15.0 | 0.0 | 0.6 | 0.0 | 0.3 | 0.3 |
| смешанных инвестиций | 0.0 | -0.2 | 0.0 | 0.5 | 0.0 | 0.1 | 0.0 |
| хедж-фонд | -5.3 | 4.2 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| художественных ценностей | -0.1 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| товарного рынка | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| Открытые ПИФ, том числе | 0.0 | -2.4 | -0.1 | 1.9 | 0.0 | 0.9 | 0.0 |
| акций | 0.0 | -1.6 | 0.0 | 0.1 | 0.0 | 0.3 | 0.0 |
| денежного рынка | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| индексный | 0.0 | -0.2 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| облигаций | 0.0 | -0.1 | -0.1 | 1.6 | 0.0 | 0.3 | 0.0 |
| смешанных инвестиций | 0.0 | -0.2 | 0.0 | 0.1 | 0.0 | 0.1 | 0.0 |
| фонд фондов | 0.0 | -0.3 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.1 | 0.0 |
| Интервальные ПИФ, том числе | 0.0 | -0.3 | 0.0 | 0.2 | 0.0 | 0.1 | 0.0 |
| акций | 0.0 | -0.1 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| смешанных инвестиций | 0.0 | -0.1 | 0.0 | 0.1 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| товарного рынка | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| фонд фондов | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| хедж-фонд | 0.0 | -0.2 | 0.0 | 0.1 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |

| Млрд руб., на основе отчетности, присланной в I квартале 2017 года | 08 Выплата дивидендов по акциям акционерного инвестиционного фонда (дохода по инвестиционным паям паевого инвестиционного фонда) | 09 Прочие доходы | 10 Прочие расходы | 11 Прирост (+) имущества в результате размещения акций акционерного инвестиционного фонда (выдачи инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 12 Уменьшение (-) имущества в результате выкупа или приобретения акций акционерного инвестиционного фонда (погашения инвестиционных паев паевого инвестиционного фонда) | 13 Прирост (+) имущества в результате обмена инвестиционных паев других паевых инвестиционных фондов на инвестиционные паи данного паевого инвестиционного фонда | 14 Уменьшение (-) имущества в результате обмена инвестиционных паев данного паевого инвестиционного фонда на инвестиционные паи других паевых инвестиционных фондов | 15 Итого: прирост (+) или уменьшение (-) стоимости имущества (строки 01+02+03+04-05-06-07-08+09-10+11-12+13+14) |
|--|--|------------------|-------------------|--|---|--|---|---|
| Закрытые ПИФ, том числе | 14.3 | 14.2 | 8.1 | 114.0 | -11.0 | 0.0 | 0.0 | 135.3 |
| акций | 0.1 | 0.2 | 0.1 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | -1.1 |
| денежного рынка | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| долгосрочных прямых инвестиций | 0.3 | 1.0 | 0.5 | 2.0 | -5.5 | 0.0 | 0.0 | 15.3 |
| ипотечный | 0.1 | 0.1 | 0.0 | 0.0 | -0.1 | 0.0 | 0.0 | -0.2 |
| комбинированный | 0.6 | 0.0 | 0.2 | 104.5 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 127.9 |
| кредитный | 0.2 | 0.6 | 0.1 | 0.1 | -0.2 | 0.0 | 0.0 | -2.3 |
| недвижимости | 12.2 | 9.9 | 6.5 | 6.3 | -4.2 | 0.0 | 0.0 | 10.9 |
| облигаций | 0.0 | 0.1 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.1 |
| особо рискованных (венчурных) инвестиций | 0.0 | 0.1 | 0.0 | 0.8 | -0.4 | 0.0 | 0.0 | 0.3 |
| прямых инвестиций | 0.5 | 0.2 | 0.2 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | -0.3 |
| рентный | 0.4 | 1.8 | 0.5 | 0.2 | -0.1 | 0.0 | 0.0 | -13.8 |
| смешанных инвестиций | 0.1 | 0.2 | 0.1 | 0.0 | -0.4 | 0.0 | 0.0 | -0.2 |
| хедж-фонд | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | -1.1 |
| художественных ценностей | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | -0.1 |
| товарного рынка | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| Открытые ПИФ, том числе | 0.0 | 0.9 | 0.6 | 19.5 | -8.1 | 14.0 | -13.8 | 10.5 |
| акций | 0.0 | 0.3 | 0.2 | 3.6 | -2.1 | 4.7 | -4.7 | -0.4 |
| денежного рынка | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | -0.1 | 0.0 |
| индексный | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.4 | -0.1 | 0.2 | -0.2 | 0.0 |
| облигаций | 0.0 | 0.4 | 0.2 | 14.1 | -3.3 | 5.9 | -5.1 | 12.9 |
| смешанных инвестиций | 0.0 | 0.1 | 0.1 | 1.0 | -1.7 | 0.8 | -0.9 | -0.9 |
| фонд фондов | 0.0 | 0.1 | 0.1 | 0.4 | -0.7 | 2.3 | -2.9 | -1.3 |
| Интервальные ПИФ, том числе | 0.0 | 0.8 | 0.5 | 0.1 | -0.1 | 0.0 | 0.0 | 0.1 |
| акций | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | -0.1 |
| смешанных инвестиций | 0.0 | 0.1 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | -0.1 |
| товарного рынка | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| фонд фондов | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.0 |
| хедж-фонд | 0.0 | 0.7 | 0.4 | 0.1 | 0.0 | 0.0 | 0.0 | 0.3 |

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

Общие положения

В таблице раздела 3 «Ключевые показатели некредитных финансовых организаций» 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 фонда 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 % годовых производится на основе показателя доходности за период с начала года.

Выдача и погашение инвестиционных паев ПИФов представляет собой сумму показателей выдачи инвестиционных паев ПИФ и сумму показателей погашения инвестиционных паев ПИФ. В расчете учитываются ПИФы, сформированные в отчетном периоде, и ПИФы, находящиеся на стадии прекращения.

Изменение стоимости имущества ПИФов представлено в соответствии с месячной формой ОКУД 0420503. Изменение стоимости имущества ПИФов может не совпадать с приростом СЧА (в соответствии со справкой СЧА), который фиксируется в Обзоре по состоянию на дату

