



Банк России

Центральный банк Российской Федерации



№ 2

2016

Информационно-
аналитические
материалы

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

Москва

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

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

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

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

СОДЕРЖАНИЕ

1. ПРОФЕССИОНАЛЬНЫЕ УЧАСТНИКИ РЫНКА ЦЕННЫХ БУМАГ.....	5
1.1. БРОКЕРЫ, ДИЛЕРЫ И ДОВЕРИТЕЛЬНЫЕ УПРАВЛЯЮЩИЕ.....	6
1.2. РЕГИСТРАТОРЫ.....	10
2. КЛЮЧЕВЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ ПРОФЕССИОНАЛЬНЫХ УЧАСТНИКОВ РЫНКА ЦЕННЫХ БУ- МАГ.....	12
3. МЕТОДИЧЕСКИЕ ПОЯСНЕНИЯ К КЛЮЧЕВЫМ ПОКАЗАТЕЛЯМ ПРОФЕССИОНАЛЬНЫХ УЧАСТНИКОВ РЫНКА ЦЕННЫХ БУМАГ.....	14

1. ПРОФЕССИОНАЛЬНЫЕ УЧАСТНИКИ РЫНКА ЦЕННЫХ БУМАГ

Во втором квартале 2016 года продолжилось сокращение количества профессиональных участников рынка ценных бумаг – на 4,1%, до 798 компаний. На конец квартала действовало 457 некредитных финансовых организаций (профучастников-НФО) и 341 кредитная организация (профучастника-КО) с лицензией профессионального участника рынка ценных бумаг.

За период с апреля по июнь включительно у профессиональных участников рынка ценных бумаг было аннулировано 112 лицензий. Низкая рентабельность бизнеса и ужесточение регулирования остаются основными причинами ухода компаний с рынка: среди причин отзыва лицензий на долю собственных заявлений приходится 40,2% (45 лицензий). Чуть более трети лицензий (36,6%) аннулированы в связи с отзывом лицензии на осуществление банковских операций. В 20,5% случаев (23 лицензии) причиной отзыва стали нарушения.

Еще 2,7% лицензий отозвано по иным причинам.

В то же время концентрация сегмента осталась на уровне января-марта 2016 года: 80% активов профучастников-НФО контролирует 30 организаций, что составляет 6,6% от их совокупного количества (31 компания или 6,5% в первом квартале 2016 года).

В целях дальнейшего совершенствования регулирования в отношении профессиональных участников рынка ценных бумаг во II квартале 2016 года был принят ряд нормативных актов Банка России. В частности, утверждены требования² к организации системы учета документов, относящихся к ведению депозитарного учета, а также связанных с учетом и переходом прав на ценные бумаги.

В рамках нормативной деятельности регулятора Банком России разработаны методические рекомендации³ по определению пре-

Рисунок 1.1

Динамика количества¹ организаций-профессиональных участников рынка ценных бумаг (ед.)



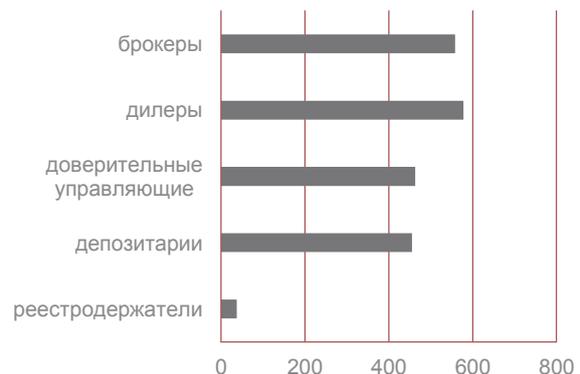
Источник: Банк России

¹ Если не указано иное, здесь и далее приводятся значения на конец соответствующего периода.

² Положение Банка России от 13.05.2016 № 542-П «О требованиях к осуществлению депозитарной деятельности при формировании записей на основании документов, относящихся к ведению депозитарного учета, а также документов, связанных с учетом и переходом прав на

Рисунок 1.2

Количество лицензий по видам деятельности на конец второго квартала 2016 года (ед.)

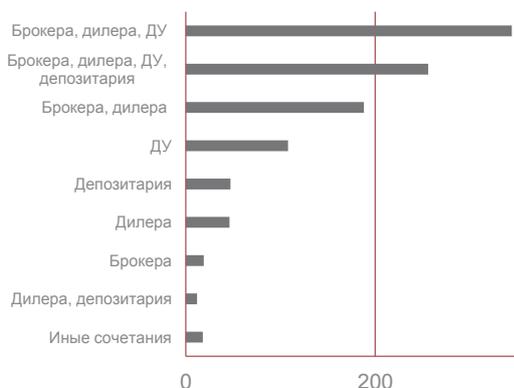


Источник: Банк России

ценные бумаги, и при хранении указанных документов»

³ «Методические рекомендации по определению предельных размеров позиций клиентов участников организованных торгов иностранной валютой при совершении некоторых видов сделок» (утв. Банком России 24.05.2016 N 18-МР)

Рисунок 1.3
Сочетание лицензий по видам деятельности на
конец второго квартала 2016 года (%)



Источник: Банк России

дельных размеров позиций клиентов при совершении некоторых видов сделок. Эти рекомендации предназначены для участников торгов, предоставляющих клиентам возможность заключения сделок с иностранной валютой на организованных торгах, и клиринговых организаций, осуществляющих клиринг по итогам организованных торгов иностранной валютой.

1.1. Брокеры, дилеры и доверительные управляющие

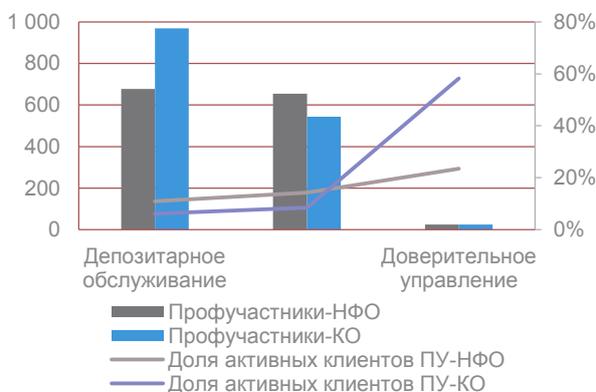
Общее количество клиентов профучастников сохранилось на уровне конца первого квартала 2016 года и составило 2,9 млн. При этом 98% (2,8 млн) из них составляют физические лица. Доля активных клиентов, совершавших сделки за отчетный период, составляет 10%.

Количество клиентов профучастников-НФО за второй квартал 2016 года увеличилось на 1,5%, до 1,4 млн. Доля физических лиц среди них составляет 97%, доля активных клиентов – 13%. С начала года эти показатели практически не изменились.

Общее количество клиентов профучастников-КО за отчетный период увеличилось на 2% и на конец второго квартала незначительно превышает 1,5 млн. На долю физических лиц приходится 98%, доля активных клиентов составляет 7%.

В разрезе направлений деятельности ос-

Рисунок 1.4
Количество клиентов профучастников по видам
деятельности на конец второго квартала 2016
года (тыс. ед.)



Источник: Банк России

Рисунок 1.5
Динамика среднего за квартал количества клиен-
тов участников торгов на фондовом рынке Мос-
ковской Биржи (ед.)



Источник: Московская Биржа

новная доля клиентов профучастников приходится на депозитарное обслуживание. За второй квартал 2016 года их количество у профучастников-НФО не изменилось, сохранившись на уровне 677,6 тыс. единиц (50% всех клиентов). Среди профучастников-КО количество клиентов депозитарного обслуживания за отчетный период увеличилось на 1%, до 968,6 тыс. единиц (64% всех клиентов). Доля активных клиентов составляет 11% и 16% соответственно.

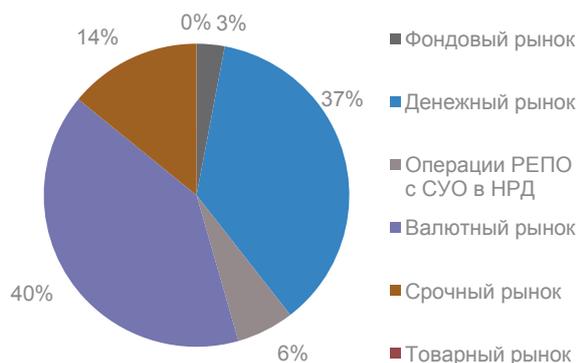
За второй квартал 2016 года профучастники-НФО смогли увеличить количество клиентов брокерского обслуживания на 3% относительно уровня первого квартала – до 654,2

Рисунок 1.6
Динамика количества ИИС (ед.)



Источник: Московская Биржа

Рисунок 1.7
Структура торгов на Московской Бирже в разрезе рынков за II квартал 2016 года (%)



Источник: Московская Биржа

тыс. единиц. Кредитные организации за тот же период продемонстрировали рост клиентской базы на 2%, до 543,5 тыс. единиц. Клиенты брокерского обслуживания составляют 48% и 36% общего числа клиентов соответственно. Доля активных клиентов по этому направлению деятельности у профучастников-НФО составляет 14%, у профучастников-КО - 9%.

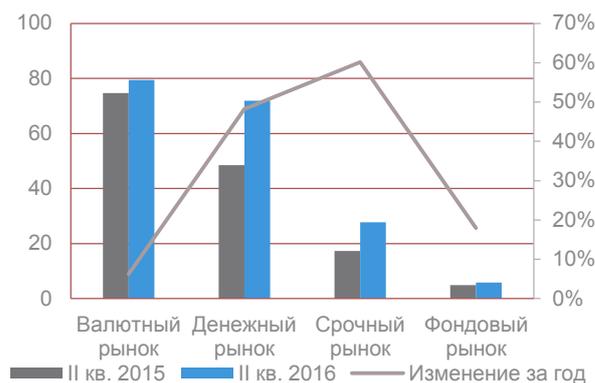
Традиционно наименьшее количество клиентов приходится на доверительное управление – оно составляет около 2% от общего количества клиентов как кредитных, так и некредитных организаций-профессиональных участников. Причиной такого распределения является более высокий входной порог в сегмент. При этом количество клиентов доверительного управления

Рисунок 1.8
Динамика торгов на Московской Бирже в разрезе рынков (млрд руб.)



Источник: Московская Биржа

Рисунок 1.9
Динамика объемов торгов в разрезе рынков (трлн руб.)



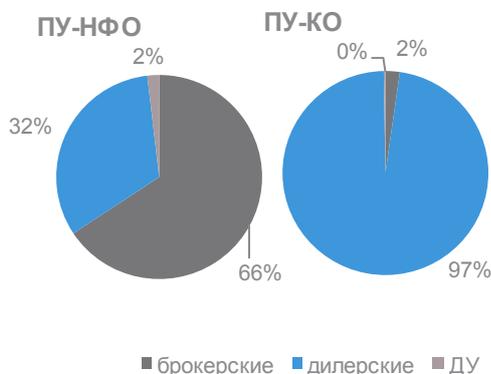
Источник: Московская Биржа

в кредитных организациях продолжает сокращаться (-13% за отчетный период) и на конец второго квартала 2016 года составляет 839 единиц. Количество клиентов профучастников-НФО по этому виду деятельности за отчетный период напротив увеличилось на 10% и достигло 25,8 тыс. Доля активных клиентов этого типа традиционно наиболее высокая: у профучастников-НФО она составляет 24%, у профучастников-КО – 58%.

Общее количество клиентов, зарегистрированных на Московской Бирже, продолжает медленный рост – по итогам второго квартала их количество достигло 1,4 млн единиц (+2% к первому кварталу 2016 года). При этом доля активных клиентов сокращается с начала 2016 года и на конец отчетного периода составляет 6,3%, что соответ-

Рисунок 1.10

Структура внебиржевых сделок профессиональных участников рынка ценных бумаг по видам деятельности за второй квартал 2016 года (%)



Источник: Банк России

Рисунок 1.11

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



Источник: Банк России

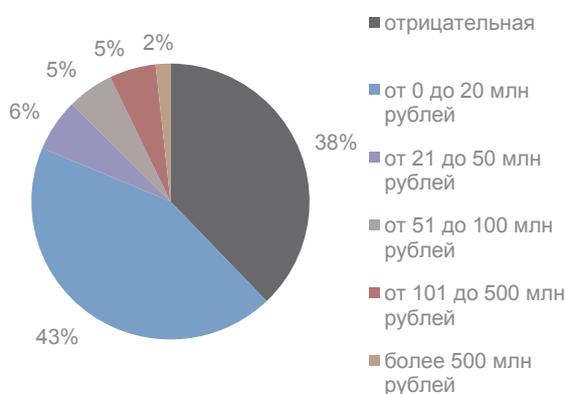
ствует снижению на 0,1 п.п. второй квартал подряд.

Количество открытых индивидуальных инвестиционных счетов (ИИС) к середине 2016 года превысило 130 тысяч. После всплеска активности в конце 2015 года среднемесячное количество новых счетов достаточно стабильно и составляет около 7 тыс. ИИС.

Общий объем торгов на Московской Бирже во втором квартале 2016 года показал прирост на четверть относительно соответствующего периода прошлого года и составил 196,9 трлн рублей. Наибольший прирост продемонстрировали денежный и срочный сегменты рынка, составляющие совместно чуть более полови-

Рисунок 1.12

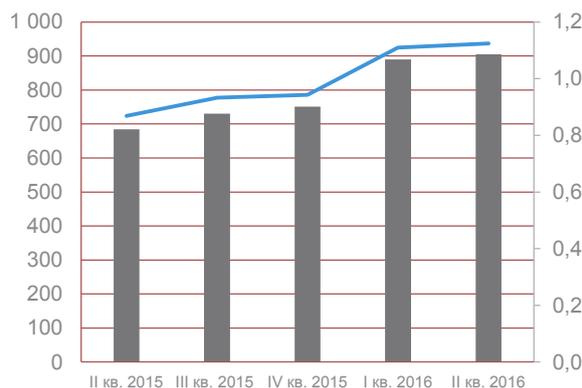
Распределение количества профучастников-НФО в зависимости от объема чистой прибыли за первое полугодие 2016 года (%)



Источник: Банк России

Рисунок 1.13

Совокупные активы профессиональных участников рынка ценных бумаг-НФО, млрд руб., и доля активов в ВВП(%, пр. шк.)

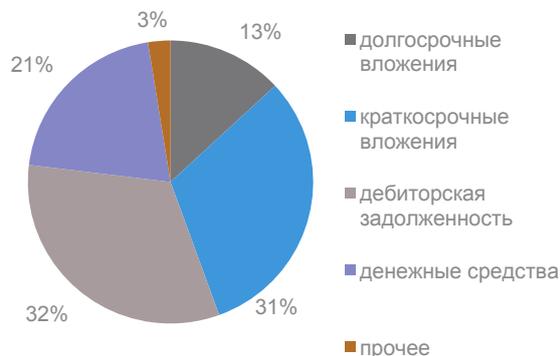


Источник: Банк России

ны всего объема торгов.

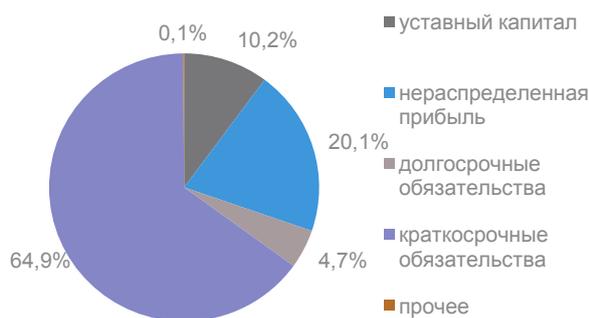
Лидером по объему торгов на Московской Бирже по-прежнему является валютный рынок – на его долю приходится 40% общего объема торгов. Во втором квартале 2016 года этот сегмент показал прирост на 6% относительно соответствующего периода прошлого года, что привело к росту объема торгов до 79,4 трлн рублей. При этом объем спот-сделок, на которые приходится чуть менее трети валютного рынка, увеличился на 16%, сделки своп и форварды, объем которых составляет 69% рынка, показали прирост на 2%. Основной объем торгов на этом рынке (85%) приходится на валютную пару доллар/

Рисунок 1.14
Структура активов профучастников-НФО на конец второго квартала 2016 года (%)



Источник: Банк России

Рисунок 1.15
Структура пассивов финансовых посредников на конец первого квартала 2016 года (%)

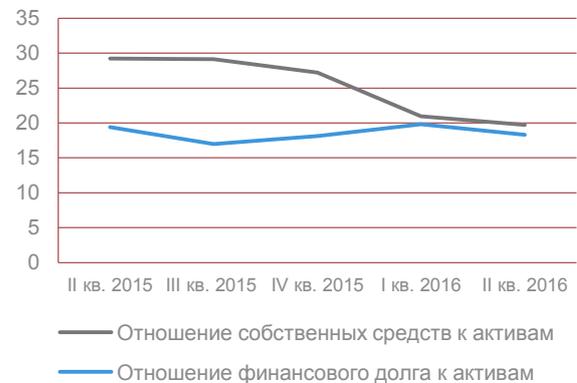


Источник: Банк России

рубль.

Денежный рынок, на который приходится 37% общего объема торгов, показал 48% прироста к соответствующему периоду прошлого года, объем торгов составил 71,9 трлн рублей. Объемы операций РЕПО с ЦК демонстрирует значительный рост (до 38,5 трлн рублей или +213% к соответствующему периоду прошлого года). В частности, объем операций РЕПО с клиринговыми сертификатами участия (КСУ), введенные в конце февраля 2016 года, вырос до 82 млрд рублей (7 млрд рублей в первом квартале 2016 года). В этом сегменте рынка во втором квартале 2016 года в дополнение к пулу «все облигации» стали доступны новые инстру-

Рисунок 1.16
Динамика коэффициентов, отражающих уровень финансовой независимости профучастников-НФО (%)



Источник: Банк России

менты – пул акций и пул ОФЗ, что расширяет возможности участников рынка по управлению ликвидностью. В то же время значительное сокращение объемов прямого РЕПО с Банком России (до 9,8 трлн рублей или -53% к уровню второго квартала 2015 года) может быть признаком перехода к структурному профициту ликвидности.

Срочный рынок (14% совокупных объемов торгов) является лидером по темпам прироста – 60% к уровню второго квартала 2015 года. Рост продемонстрировали все секции рынка, включая товарные и индексные инструменты. Доля валютных фьючерсов составляет 51% от общего объема торгов фьючерсами. Структура срочного рынка остается стабильной, доля опционов в общем объеме торгов не превышает 4%.

Фондовый рынок, на который приходится 3% общего объема торгов, продемонстрировал годовой прирост 18%. Рост обусловлен секцией облигаций (+27% к соответствующему периоду прошлого года), в частности – ростом объема размещений корпоративных облигаций (+36%). Во втором квартале 2016 года объем торгов фондового рынка составил 5,8 трлн рублей.

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

⁵ Сравнение с аналогичным периодом прошлого года невозможно в силу того, что формы отчетности по внебиржевым сделкам введены с III квартала 2015 г.

Объем торгов⁴ на внебиржевом рынке во втором квартале 2016 года вырос вдвое по сравнению с первым кварталом⁵, – до 15,7 трлн рублей. Наибольший объем приходится на собственные сделки профучастников-КО (13,5 трлн рублей). Совокупный объем сделок профучастников-НФО составляет 2,2 трлн рублей.

Внебиржевые обороты по сделкам, информация о которых направляется в репозиторий, составляют 19,2 трлн рублей, что на 6% меньше уровня предыдущего квартала.

Чистая прибыль⁶ профессиональных участников рынка ценных бумаг (некредитные организации) с начала года составила 9,7 млрд рублей, что втрое превышает показатель соответствующего периода годом ранее (3,0 млрд рублей). Такой результат обусловлен увеличением доходов от основной деятельности, а также ростом процентных доходов.

Совокупные активы профучастников-НФО показали прирост на 32% относительно соответствующего периода прошлого года и достигли 905,2 млрд рублей, оставшись на уровне 1,1% ВВП.

Структура активов профучастников-НФО остается стабильной, около трети совокупного портфеля составляют краткосрочные финансовые вложения и дебиторская задолженность (31% и 32% соответственно). Подобное распределение связано с особенностью деятельности профучастников-НФО.

В структуре пассивов профучастников-НФО преобладают краткосрочные обязательства – их доля составляет 65%, а объем достигает 587,6 млрд. рублей. Нераспределенная прибыль (с учетом сальдированной нераспределенной прибыли прошлых лет) достигает 20% пассивов и на конец второго квартала 2016 года составляет 181,9 млрд

рублей.

Объем собственных средств профучастников - НФО, рассчитанных с учетом поправочных коэффициентов⁷, по сравнению с соответствующим периодом прошлого года сократился на 11% и составил 174,7 млрд рублей. При этом отношение собственных средств к акти-

1.2. Регистраторы

Количество регистраторов во втором квартале 2016 года сократилось на одну организацию – до 37 компаний. При этом общее количество обслуживаемых реестров за отчетный период сократилось на 1%, как и общее количество зарегистрированных лиц, до 62,1 тыс. и 35,6 млн единиц соответственно. При этом количество зарегистрированных лиц, на счетах которых учитываются ценные бумаги, сократилось на 2% и составляет 24,7 млн единиц.

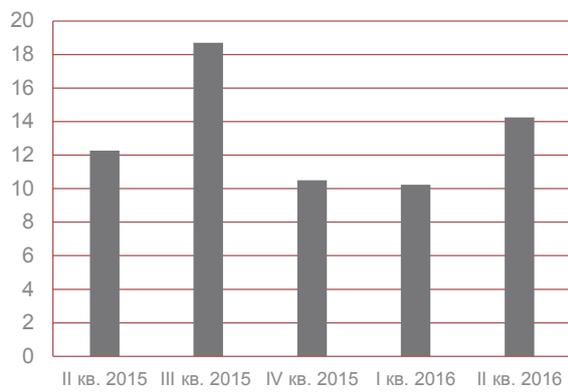
Объем активов регистраторов увеличился до 14,3 млрд рублей (+16% к соответствующему периоду прошлого года). В структуре активов доля денежных средств увеличилась до 52% (35% кварталом ранее). Доли краткосрочных вложений и дебиторской задолженности составляют 15% и 10% соответственно.

Во втором квартале 2016 года чистая прибыль регистраторов составила 589 млн рублей, что почти вдвое ниже соответствующего показателя годом ранее (937 млн рублей), но существенно лучше результата прошлого квартала (-87,6 млн рублей). Рост доходов обеспечило увеличение количества общих собраний акционеров, а также развитие сектора дополнительных услуг.

⁷ В соответствии с Указанием Банка России от 15.01.2015 №3533-У, Положением «О порядке расчета собственных средств профессиональных участников рынка ценных бумаг, управляющих компаний инвестиционных фондов, паевых инвестиционных фондов и негосударственных пенсионных фондов, товарных бирж и биржевых посредников, заключающих в биржевой торговле договоры, являющиеся производными финансовыми инструментами, базисным активом которых является биржевой товар» (утв. Приказом ФСФР от 23.10.2008 №08-41/пз-н).

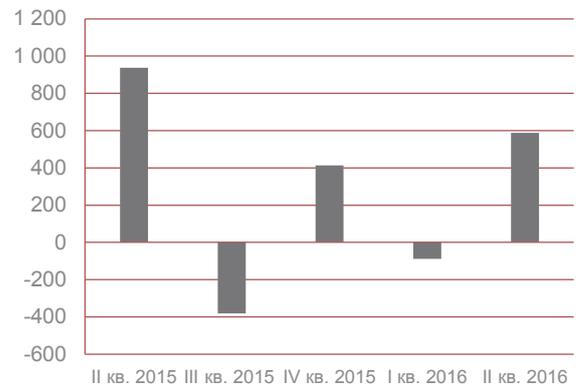
⁶ Из расчета исключена компания, прибыль которой была сформирована неправомерным образом (лицензия отозвана 25.08.2016)

Рисунок 1.17
Совокупные активы регистраторов на конец вто-
рого квартала 2016 года (млрд руб.)



Источник: Банк России

Рисунок 1.18
Чистая прибыль регистраторов поквартально,
(млн руб.)



Источник: Банк России

2. КЛЮЧЕВЫЕ ПОКАЗАТЕЛИ ПРОФЕССИОНАЛЬНЫХ УЧАСТНИКОВ РЫНКА ЦЕННЫХ БУМАГ

	Единица измерения	4 кв. 2014	1 кв. 2015	2 кв. 2015	3 кв. 2015	4 кв. 2015	1 кв. 2016	2 кв. 2016	Изменение за год, %
Количество кредитных и некредитных организаций, имеющих лицензию профессионального участника рынка ценных бумаг	ед.	1 079	1 039	832	933	875	832	798	-4,1
Количество НКО -- профессиональных участников рынка ценных бумаг	ед.	641	617	475	540	501	475	457	-3,8
Количество НКО - профессиональных участников рынка ценных бумаг, сдавших баланс (по данным сопнос)				532	512	465	457	441	-17,1
Количество ПУ-НКО с лицензией на ведение реестра владельцев ценных бумаг	ед.	39	40	40	39	39	38	37	-7,5
Количество ПУ-НКО расчетных депозитариев			50			47	47	40	
Концентрация									
Количество компаний, совместно контролирующих 80% активов (профучастники-НКО)	ед.	55	55	51	45	38,0	31,0	30,0	-41,2
Количество компаний, совместно контролирующих 80% активов (профучастники-НКО)	%	8,6	8,9	10,7	8,3	7,6	6,5	6,6	-38,9
Активы	млн руб.	756 023,52	767 182,55	697 107,34	748 823,72	761 785,74	900 359,69	919 467,80	31,90
в том числе профессиональных участников рынка ценных бумаг (без реестродержателей)	млн руб.	738 717,6	749 270,5	684 845,8	730 132,6	751 289,5	890 130,5	905 215,0	32,2
в том числе ПУ-НКО с лицензией на ведение реестра владельцев ценных бумаг	млн руб.	17 305,9	17 912,1	12 261,5	18 691,1	10 496,3	10 229,2	14 252,8	16,2
в том числе ПУ-НКО расчетных депозитариев	млн руб.					26 227,9	32 641,7	32 450,8	
Отношение активов к ВВП	%	0,97	0,97	0,87	0,93	0,94	1,11	1,12	29,51
Собственные средства	млн руб.	198 810,74	190 685,30	203 716,44	218 282,64	207 362,07	188 812,64	181 563,00	-10,87
в том числе управляющих компаний и профессиональных участников рынка ценных бумаг (без реестродержателей)	млн руб.	192 655,4	184 435,3	196 967,7	211 677,5	201 131,7	182 025,3	174 663,6	-11,3
в том числе ПУ с лицензией на деятельность по ведению реестра владельцев ценных бумаг	млн руб.	6 155,3	6 250,0	6 748,8	6 605,1	6 230,4	6 787,3	6 899,4	2,2
в том числе ПУ-НКО расчетных депозитариев							13 941,1	12 790,7	

	Единица измерения	4 кв. 2014	1 кв. 2015	2 кв. 2015	3 кв. 2015	4 кв. 2015	1 кв. 2016	2 кв. 2016	Изменение за год, %
Капитал и резервы	млн руб.			256 479,5	281 869,7	262 757,2	285 784,5	283 955,3	10,7
в том числе профессиональных участников рынка ценных бумаг (без реестродержателей)	млн руб.			247 922,3	272 797,1	254 136,0	277 178,6	275 121,2	11,0
в том числе ПУ с лицензией на деятельность по ведению реестра владельцев ценных бумаг	млн руб.			8 557,2	9 072,6	8 621,3	8 605,8	8 834,1	3,2
в том числе ПУ-НКО расчетных депозитариев	млн руб.					16 601,1	17 574,2	16 176,6	
Обязательства по основному виду деятельности (краткосрочные кредиты и займы)	млн руб.	100 930,56	102 006,99	102 385,56	90 106,36	100 003,77	136 593,09	131 622,50	28,6
в том числе профессиональных участников рынка ценных бумаг (без реестродержателей)	млн руб.	100 921,5	102 003,0	102 384,2	90 102,2	100 002,4	136 592,2	131 621,2	28,6
в том числе ПУ с лицензией на деятельность по ведению реестра владельцев ценных бумаг	млн руб.	9,0	4,0	1,4	4,2	1,4	0,9	1,3	-5,2
в том числе ПУ-НКО расчетных депозитариев	млн руб.					1,4	1,0	1,0	
Прочие обязательства	млн руб.			338 242,31	376 847,62	399 024,73	477 982,14	503 890,00	49,0
в том числе профессиональных участников рынка ценных бумаг (без реестродержателей)	млн руб.			334 539,4	367 233,3	397 151,1	476 359,7	498 472,6	49,0
в том числе ПУ с лицензией на деятельность по ведению реестра владельцев ценных бумаг	млн руб.			3 702,9	9 614,3	1 873,6	1 622,5	5 417,4	46,3
в том числе ПУ-НКО расчетных депозитариев	млн руб.					9 625,5	15 066,5	16 273,2	
Кредиторская задолженность	млн руб.	330 147,76	347 732,50	281 578,96	315 597,99	335 542,67	416 496,09	449 423,80	59,61
в том числе профессиональных участников рынка ценных бумаг (без реестродержателей)	млн руб.	327 418,6	345 038,6	278 070,5	306 181,1	334 369,3	415 157,8	444 319,0	59,8
в том числе ПУ с лицензией на деятельность по ведению реестра владельцев ценных бумаг	млн руб.	2 729,1	2 693,9	3 508,5	9 416,9	1 173,3	1 338,2	5 104,8	45,5
в том числе ПУ-НКО расчетных депозитариев	млн руб.					9 186,0	14 595,8	14 678,2	
Запас капитала	%	197,0	186,9	199,0	242,2	207,4	138,2	137,9	-30,7
Отношение собственных средств к активам	%	26,3	24,9	29,2	29,2	27,2	21,0	19,7	-32,4
Долгосрочные кредиты и займы	млн руб.	37 163,8	35 356,1	32 849,4	37 120,9	38 093,0	41 872,9	36 695,0	11,7
в том числе профессиональных участников рынка ценных бумаг (без реестродержателей)	млн руб.	37 157,0	35 356,1	32 849,4	37 120,9	38 093,0	41 872,0	36 694,1	11,7
в том числе ПУ с лицензией на деятельность по ведению реестра владельцев ценных бумаг	млн руб.	6,8	0,0	0,0	0,0	0,0	0,9	0,9	0,0
в том числе ПУ-НКО расчетных депозитариев	млн руб.					4,0	3,9	3,9	
Размер финансового долга (долгосрочные + краткосрочные займы)	млн руб.	138 094,3	137 363,1	135 235,0	127 227,3	138 096,7	178 466,0	168 317,5	24,5
Отношение финансового долга к активам	%	18,3	17,9	19,4	17,0	18,1	19,8	18,3	-5,6
Чистая прибыль за отчетный период с начала отчетного года	млн руб.	24 552,85	244,52	4 004,05	28 746,99	23 121,39	23 661,98	28 732,30	617,6
в том числе профессиональных участников рынка ценных бумаг (без реестродержателей)	млн руб.	24 178,36	166,18	2 988,52	28 112,00	22 073,23	23 749,58	28 231,40	844,7
в том числе ПУ с лицензией на деятельность по ведению реестра владельцев ценных бумаг	млн руб.	374,49	78,34	1 015,52	634,99	1 048,15	-87,60	500,90	-50,7
в том числе ПУ-НКО расчетных депозитариев	млн руб.		1 043,08				1 043,08	1 953,88	

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

Общие положения

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

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

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

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

Характеристика отдельных показателей

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

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

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

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

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

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

предоставленных займов;

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

ном месяце совершена хотя бы одна сделка.

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

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

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

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

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

