

## МЕТОДИКА РАСЧЕТА РЭНКИНГОВ ПАЕВЫХ ФОНДОВ И РЭНКИНГОВ УПРАВЛЯЮЩИХ КОМПАНИЙ ПАЕВЫХ ФОНДОВ

*в редакции от 23.10.2020*

### I. Общие положения

1. Рэнкинги паевых инвестиционных фондов (Далее – Рэнкинги) публикуются в целях предоставления информации об оценке изменения стоимости пая, чистого притока и оттока средств и общей стоимости активов паевых фондов (далее – ПИФ) и управляющих компаний паевыми фондами (далее – УК) на российском финансовом рынке.
2. Рэнкинги паевых инвестиционных фондов разрабатываются ООО «Сбондс.ру» на основе данной методики.
3. Рассчитываются следующие виды Рэнкингов:
  - Рэнкинг ПИФ по доходности за 1 месяц
  - Рэнкинг ПИФ по доходности с начала года
  - Рэнкинг ПИФ по доходности за год
  - Рэнкинг ПИФ по доходности за 3 года
  - Рэнкинг ПИФ по доходности за 5 лет
  - Рэнкинг ПИФ по объему привлеченных средств за 1 месяц
  - Рэнкинг ПИФ по объему привлеченных средств с начала года
  - Рэнкинг ПИФ по объему привлеченных средств за год
  - Рэнкинг ПИФ по объему привлеченных средств за 3 года
  - Рэнкинг ПИФ по объему привлеченных средств за 5 лет
  - Рэнкинг ПИФ по стоимости чистых активов
  - Рэнкинг ПИФ по инфраструктурным расходам
  - Рэнкинг УК по объему привлеченных средств с начала года
  - Рэнкинг УК по объему привлеченных средств за год
  - Рэнкинг УК по объему привлеченных средств за 3 года
4. Рэнкинги не являются показателем качества услуг и профессионализма. ООО «Сбондс.ру» не несет ответственности за некорректное использование результатов Рэнкинга в рекламных и маркетинговых целях.
5. Рэнкинги рассчитываются ежемесячно: по открытым и биржевым фондам на 2 второй рабочий день месяца, по интервальным фондам – на 3 рабочий день месяца, по закрытым фондам – на 10 рабочий день месяца.
6. Рэнкинги рассчитываются на основе данных, предоставленных управляющими компаниями паевых инвестиционных фондов или на основе данных, публично раскрытых на официальных сайтах управляющих компаний.

## II. Критерии формирования и принципы расчета Рэнкингов

7. В Рэнкингах учитываются паевые фонды, не являющиеся фондами для квалифицированных инвесторов.
8. В качестве даты расчета Рэнкинга принимается последний рабочий день предыдущего месяца (далее – Дата расчета).
9. Для целей расчета Рэнкингов по доходности и по объему привлеченных средства с указанием периода началом периода считается *последний рабочий день*:
  - Месяца, предыдущего Дате расчета - для периода «за 1 месяц»
  - Предыдущего года – для периода «с начала года»
  - Месяца Даты расчета в предыдущем году – для периода «за 1 год»
  - Месяца Даты расчета 3 года назад – для периода «за 3 года»
  - Месяца Даты расчета 5 лет назад – для периода «за 5 лет»
10. Прирост стоимости пая для целей расчета Рэнкингов ПИФ по доходности рассчитывается для каждого фонда как относительное изменения расчетной стоимости пая на Дату расчета к соответствующей дате начала периода, или по следующей формуле:

$$\text{Прирост} = \left( \frac{\text{пай}_e}{\text{пай}_s} - 1 \right) \times 100\%, \text{ где}$$

$\text{пай}_e$  – значение расчетной стоимости пая на дату расчета рэнкинга

$\text{пай}_s$  – значение расчетной стоимости пая на начало соответствующего периода

11. В расчет Рэнкингов по доходности попадают только фонды, которые имели значение расчетной стоимости пая на дату расчета и дату начала соответствующего периода.
12. Объем привлеченных средства для целей расчета Рэнкингов ПИФ по объему привлеченных средств для каждого фонда рассчитывается по следующей формуле

$$\text{ОПС} = \sum \left( \text{СЧА}_t - \text{пай}_t \frac{\text{СЧА}_{t-1}}{\text{пай}_{t-1}} \right)$$

$\text{пай}_t$  – расчетная стоимость пая на день t

$\text{СЧА}_t$  – стоимость чистых активов на день t

$\text{пай}_{t-1}$  – расчетная стоимость пая на рабочий день, предыдущий дню t

$\text{СЧА}_{t-1}$  – стоимость чистых активов на рабочий день, предыдущий дню t

t – каждый день от начала соответствующего периода (не включая дату начала периода) до Даты расчета (включительно), на который есть данные о расчетной стоимости пая и чистых активах.

13. Если фонд сформировался в период расчета, то к сумме, рассчитанной по формуле в п.10 прибавляется стоимость чистых активов на дату окончания формирования фонда.

14. В расчет Рэнкингов по объему привлеченных средств попадают только фонды, которые имели значение расчетной стоимости пая на дату расчета Рэнкинга.
15. Стоимость чистых активов для целей расчета Рэнкинга ПИФ по стоимости чистых активов определяется на дату расчета Рэнкинга
16. Под инфраструктурными расходами для целей расчета Рэнкинга по инфраструктурным расходам понимается сумма следующих значений:
  - Вознаграждение управляющей компании
  - Вознаграждение специализированного депозитария, регистратора и прочих (указывается максимальное значение)
  - Прочие расходы (указывается максимальное значение)
17. Для целей Рэнкинга по инфраструктурным расходам дата расчета не указывается, Рэнкинг отражает актуальное состояние вознаграждений и расходов фонда.
18. Для целей Рэнкингов по объему привлеченных средств УК объем привлеченных средств УК за каждый период рассчитывается как сумма значений объема привлеченных средств ПИФов, относящихся на дату расчета Рэнкингов к данной УК, за вычетом стоимости чистых активов ПИФов данной УК, прекративших деятельность в соответствующий период. Для расчета стоимости чистых активов ПИФов, прекративших деятельность, используется значение на последнюю имеющуюся дату соответствующего периода.
19. Для целей расчета Рэнкингов по объему привлеченных средств УК объем привлеченных средств ПИФ считается аналогично п. 10. и п.11.
20. Для целей расчета Рэнкингов по стоимости чистых активов стоимость чистых активов УК рассчитывается как сумма стоимости чистых активов ПИФов, относящихся на дату расчета Рэнкингов к данной УК.

**Контактные лица по вопросам, касающимся представленных рэнкингов:**

Маркова Наталия Николаевна

Руководитель проекта Investfunds.ru

тел: + 7 (812) 336-97-21, доб.229.

e-mail: [markova@cbonds.info](mailto:markova@cbonds.info)