



ПРЕССЪОБЩЕНИЕ

17 февруари 2010 г.

12:00 ч.

СТАТИСТИКА НА ИНВЕСТИЦИОННИТЕ ФОНДОВЕ

Декември 2009 г.

Средствата, управлявани от местните и чуждестранните инвестиционни фондове^{1,2}, които осъществяват дейност в България възлизат на 608.5 млн. лв. към 31.12.2009 г. Техният размер нараства със 152.7 млн. лв. (33.5%), в сравнение с 31.12.2008 г. (455.7 млн. лв.). Спрямо 30.09.2009 г., управляваните средства (558.9 млн. лв.) се увеличават с 49.6 млн. лв. (8.9%).

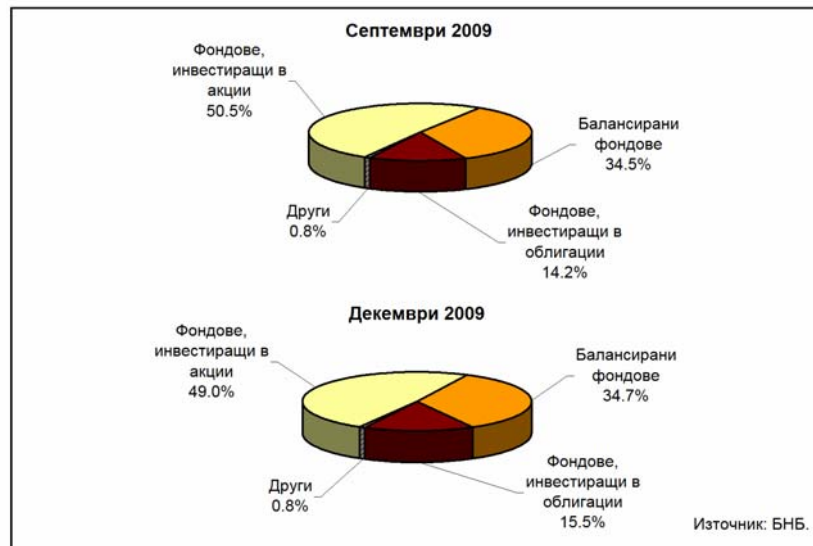
1. Размер и структура на активите

Активите на местните инвестиционни фондове достигнаха 316 млн. лв. към 31.12.2009 г., като спрямо 31.12.2008 г., те се увеличават с 29.8 млн. лв. (10.4%). В сравнение с 30.09.2009 г. активите (325.2 млн. лв.) намаляват с 9.3 млн. лв. (2.8%).

Активите на фондовете, инвестиращи в акции към 31.12.2009 г., намаляват с 9.6 млн. лв. (5.8%), от 164.3 млн. лв. към 30.09.2009 г. до 154.7 млн. лв. към 31.12.2009 г. Управляваните средства от *балансираните фондове* намаляват с 2.4 млн. лв. (2.1%) от 112.1 млн. лв. към 30.09.2009 г. до 109.7 млн. лв. към 31.12.2009 г.

Активи на местните инвестиционни фондове
Структура по видове според инвестиционната политика

Графика 1



¹ Разделянето на инвестиционните фондове според вида и инвестиционната им политика е извършено, съгласно Регламент № 958/2007 на Европейската централна банка и други нормативни документи на ЕЦБ. При местните инвестиционни фондове, данните се събират от управляващите дружества, инвестиционните дружества от затворен тип и Централния депозитар. При чуждестранните инвестиционни фондове, данните обхващат пасивите на чуждестранни инвестиционни фондове към местни лица, като източник на информация са местните инвестиционни посредници и банките.

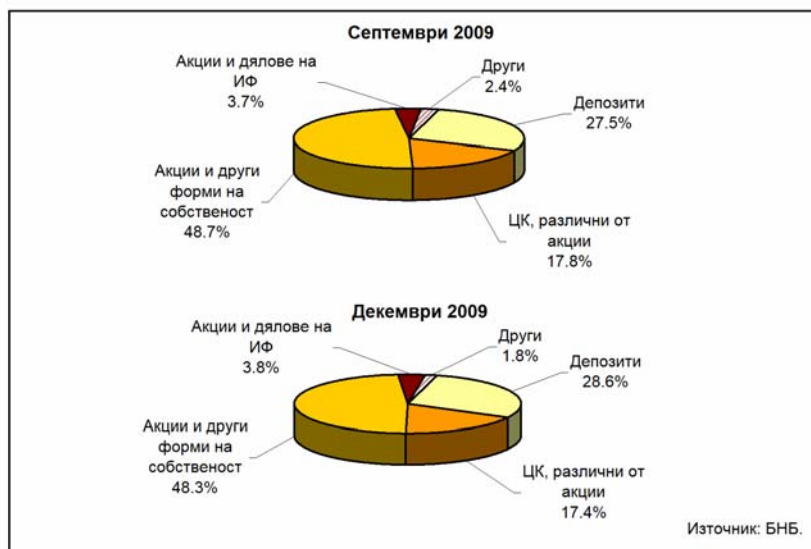
² Данните са предварителни. Пълният комплект от таблици за статистиката на инвестиционните фондове и прессъобщението се намират на Интернет страницата на БНБ в раздел *Статистика / Други финансови институции / Инвестиционни фондове*.

В обхвата на инвестиционните фондове не са включени акционерните дружества със специална инвестиционна цел (АДСИЦ), секюритизиращи недвижими имоти, които ще бъдат предмет на отделно отчитане.

Фондовете, *инвестиращи в акции* имат най - висок относителен дял (49%), спрямо общия размер на *активите на местните инвестиционни фондове* към 31.12.2009 г., при 50.5% към 30.09.2009 г. и 48.6% към 31.12.2008 г. *Балансираните фондове* притежават 34.7% от общата сума на активите към 31.12.2009 г., при относителен дял от 34.5% и 37.3%, съответно към 30.09.2009 г. и към 31.12.2008 г.

Активи на местните инвестиционни фондове Структура по инструменти

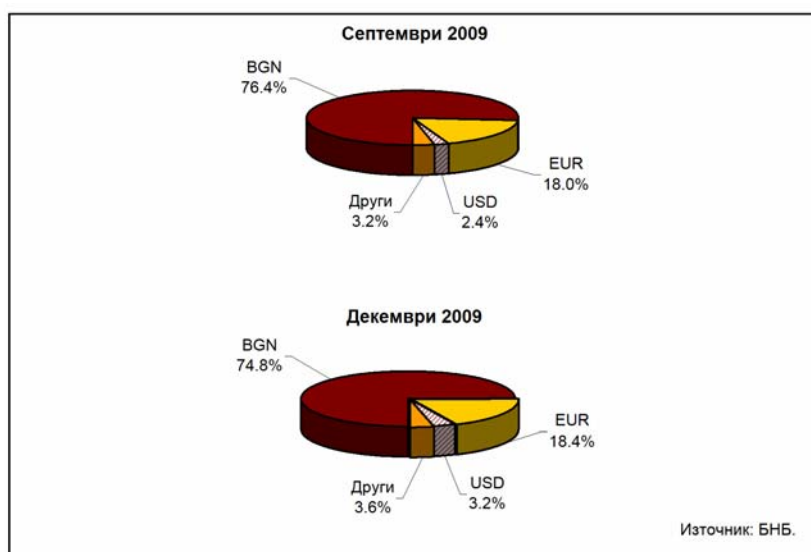
Графика 2



По отношение на *инструментите*, включени в портфейлите на *местните инвестиционни фондове*, към 31.12.2009 г., спрямо 30.09.2009 г., инвестициите в *акции и други форми на собственост* намаляват с 5.6 млн. лв. (3.5%) до 152.7 млн. лв., а средствата в *ценни книжа, различни от акции* спадат с 2.7 млн. лв. (4.7%) до 55 млн. лв. *Депозитите* се увеличават с 1.1 млн. лв. (1.3%) до 90.5 млн. лв. Най - голям относителен дял към 31.12.2009 г., в общата сума на активите имат *акции и други форми на собственост* - 48.3%, при 48.7% към 30.09.2009 г., *депозити* - 28.6%, при 27.5% към 30.09.2009 г. и *ценни книжа, различни от акции* - 17.4%, при 17.8% към 30.09.2009 г.

Активи на местните инвестиционни фондове Структура по валути

Графика 3

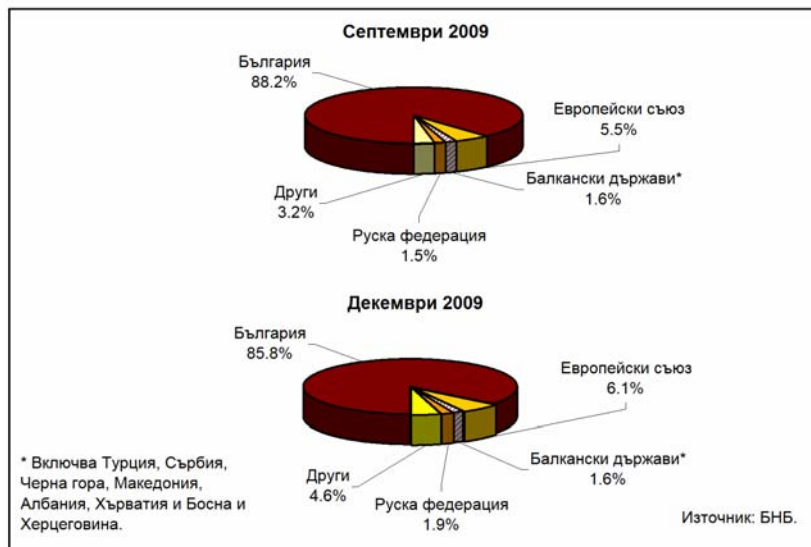


Във *валутната структура* на активите на *местните инвестиционни фондове* към 31.12.2009 г., основно значение имат активите, деноминирани в *български лева* – 74.8%, при 76.4% към 30.09.2009 г. и тези в *евро* –

18.4%, при 18% към 30.09.2009 г. Средствата, деноминирани в други валути представляват 3.6% от общия размер на активите към 31.12.2009 г.

Ценни книжа, притежавани от местните инвестиционни фондове Географска структура

Графика 4



Географската структура на ценните книжа в активите на *местните инвестиционни фондове* е ориентирана предимно към *местния пазар*, където към 31.12.2009 г. са съсредоточени 85.8% от инвестициите на местните фондове, спрямо 88.2% към 30.09.2009 г. В сравнение с 30.09.2009 г. инвестициите, реализирани в България намаляват с 12.4 млн. лв. (6.2%) до 188.6 млн. лв. към 31.12.2009 г. Към същата дата, средствата, инвестирани в страните от Европейския съюз се увеличават с 0.8 млн. лв. (6.7%) до 13.4 млн. лв., при 12.5 млн. лв. към 30.09.2009 г.

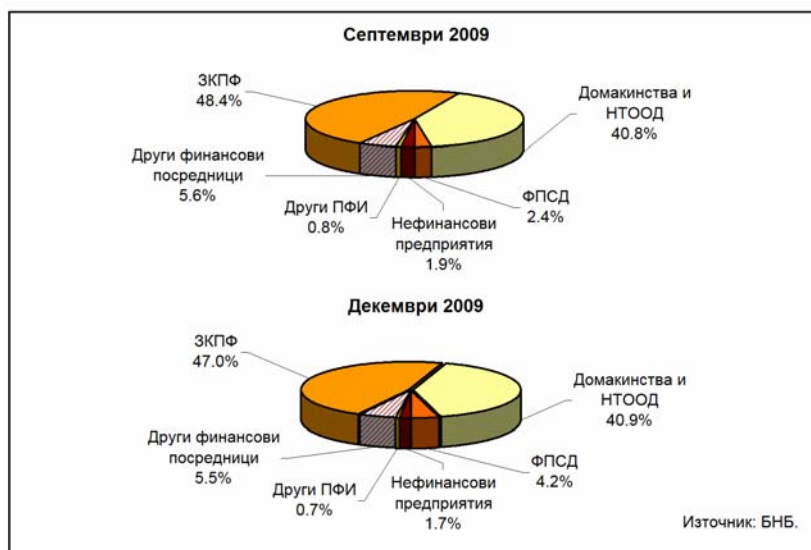
2. Размер и структура на пасивите

Привлечените средства на резиденти в чуждестранните инвестиционни фондове към 31.12.2009 г. възлизат на 292.5 млн. лв., като спрямо 31.12.2008 г. те се увеличават със 123 млн. лв. (72.5%). В сравнение с 30.09.2009 г., размерът на пасивите (233.6 млн. лв.) се увеличава с 58.9 млн. лв. (25.2%).

По институционални сектори, към 31.12.2009 г., основни инвеститори в *чуждестранните инвестиционни фондове* са *Застрахователните компании и пенсионните фондове* (47%) и *Домакинствата и нетърговските организации, обслужващи домакинствата* (40.9%). Техните дялове към 30.09.2009 г. са били съответно 48.4% и 40.8%. Към 31.12.2009 г. задълженията към сектор *Застрахователни компании и пенсионни фондове* се увеличават с 24.6 млн. лв. (21.7%) до 137.6 млн. лв., при 113.1 млн. лв. към 30.09.2009 г. Пасивите към сектор *Домакинства и нетърговски организации, обслужващи домакинствата*, към 31.12.2009 г. са в размер на 119.7 млн. лв., като техния размер нараства с 24.3 млн. лв. (25.5%), спрямо 30.09.2009 г.

**Привлечени средства на резиденти в чуждестранните инвестиционни фондове
Структура по институционални сектори**

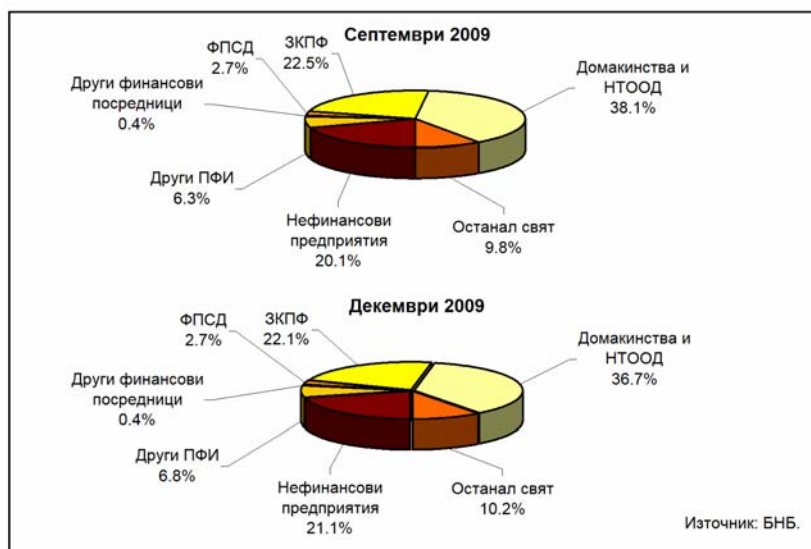
Графика 5



В пасивите на местните инвестиционни фондове, които към 31.12.2009 г. достигат 316 млн. лв., размера на собствения капитал е 315.2 млн. лв. По институционални сектори към 31.12.2009 г., най - големи дялове в собствения капитал имат резидентните *Домакинства и НТООД* (36.7%) и *Застрахователните компании и пенсионни фондове* (22.1%). Техните дялове към 30.09.2009 г. са били съответно 38.1% и 22.5%. Към 31.12.2009 г. задълженията към сектор *Домакинства и НТООД* намаляват със 7.9 млн. лв. (6.4%) до 115.6 млн. лв., при 123.4 млн. лв. към 30.09.2009 г. В сравнение с 30.09.2009 г., пасивите към сектор *Застрахователни компании и пенсионни фондове* спадат с 3.3 млн. лв. (4.5%), от 73 млн. лв. до 69.7 млн. лв. към 31.12.2009 г.

**Собствен капитал на местните инвестиционни фондове
Структура по институционални сектори**

Графика 6



Относителният дял на резидентните *Нефинансови предприятия*, в собствения капитал на *местните инвестиционни фондове* се увеличава с 1 процентен пункт до 21.1% към 31.12.2009 г., спрямо 20.1% към 30.09.2009 г. Делът на сектор *Останал свят* се увеличава до 10.2% към 31.12.2009 г., при 9.8% към 30.09.2009 г.

УПРАВЛЯВАНИ СРЕДСТВА ОТ ИНВЕСТИЦИОННИТЕ ФОНДОВЕ ПО ВИДОВЕ ФОНДОВЕ*

(млн. лв.)

Вид фонд	31.XII.2008 г.		31.III.2009 г.		30.VI.2009 г.		30.IX.2009 г.		31.XII.2009 г.	
	Брой фондове	Управлявани средства	Брой фондове	Управлявани средства	Брой фондове	Управлявани средства	Брой фондове	Управлявани средства	Брой фондове	Управлявани средства
Инвестиционни фондове – общо	171	455.7	184	439.8	235	466.3	304	558.9	255	608.5
Чуждестранни инвестиционни фондове	87	169.5	95	165.4	144	178.1	211	233.6	162	292.5
Местни инвестиционни фондове – общо	84	286.2	89	274.4	91	288.2	93	325.2	93	316.0
Фондове, инвестиращи в акции	36	139.2	40	129.0	42	142.2	43	164.3	43	154.7
Фондове, инвестиращи в облигации	15	37.6	16	42.2	16	39.6	17	46.3	17	49.1
Балансирани фондове	29	106.8	29	100.6	29	103.9	29	112.1	29	109.7
Фондове, инвестиращи в недвижими имоти и други	4	2.6	4	2.5	4	2.5	4	2.5	4	2.5

* Разделянето на инвестиционните фондове в представените групи е извършено в съответствие с Регламент №958/2007 и други нормативни документи на Европейската централна банка.

Източник: При местните инвестиционни фондове данните се събират от управляващите дружества и инвестиционните дружества от затворен тип. При чуждестранните инвестиционни фондове, данните обхващат пасивите на чуждестранни инвестиционни фондове към местни лица, като източник на информация са местните инвестиционни посредници и банките. Предварителни данни.

(млн. лв.)

АКТИВИ НА МЕСТНИТЕ ИНВЕСТИЦИОННИ ФОНДОВЕ Структура по инструменти и валути	31.12.08 г.	31.03.09 г.	30.06.09 г.	30.09.09 г.	31.12.09 г.
По инструменти	286.2	274.4	288.2	325.2	316.0
Парични средства в каса (AF.21)	2.8	1.9	2.5	2.0	1.8
Депозити (AF.22 + AF.29)	88.3	86.6	82.5	89.4	90.5
Ценни книжа, различни от акции (AF.33)	66.8	65.6	61.4	57.8	55.0
Акции и други форми на собственост (AF.51)	119.4	105.3	128.1	158.3	152.7
Акции/дялове на ИД и ДФ (AF.52)	7.2	8.7	9.9	11.9	12.0
Нефинансови активи (AN)	0.5	2.3	2.2	4.0	2.4
Финансови деривати (AF.34)	0.0	0.7	0.1	0.0	0.0
Други активи (AF.7)	1.1	3.3	1.4	1.9	1.4
По валути	286.2	274.4	288.2	325.2	316.0
BGN	209.5	206.0	221.0	248.6	236.5
EUR	63.2	57.7	55.5	58.5	58.0
USD	5.8	5.6	5.7	7.8	10.1
Други	7.7	5.0	6.0	10.4	11.4

Източник: Управляващите дружества и инвестиционните дружества от затворен тип.

Предварителни данни.

(млн. лв.)

АКТИВИ НА МЕСТНИТЕ ИНВЕСТИЦИОННИ ФОНДОВЕ Структура на портфейла от ценни книжа	31.12.08 г.	31.03.09 г.	30.06.09 г.	30.09.09 г.	31.12.09 г.
По групи страни	193.5	179.6	199.3	227.9	219.8
България	173.8	160.3	178.6	201.0	188.6
Европейски съюз	9.9	8.4	10.1	12.5	13.4
Балкански държави	3.8	2.3	2.9	3.7	3.6
Руска федерация	2.0	1.9	2.2	3.4	4.2
Други	4.1	6.8	5.5	7.2	10.0
По институционални сектори	193.5	179.6	199.3	227.9	219.8
Нефинансови предприятия (S 11)	101.4	93.3	100.6	121.0	110.6
Други ПФИ (S 122)	12.4	10.3	12.1	15.0	14.8
Други финансови посредници (S 123)	53.8	52.7	62.5	61.5	59.7
Финансови предприятия със спомагателна дейност (S 124)	0.2	0.1	0.1	0.1	0.1
Застрахователни компании и пенсионни фондове (S 125)	1.8	1.1	1.2	1.5	1.1
Държавно управление (S 13)	4.2	2.9	2.2	1.9	2.4
Сектор <i>Останал свят</i> (S 2)	19.7	19.4	20.7	26.9	31.2

Източник: Управляващите дружества и инвестиционните дружества от затворен тип.

Предварителни данни.

Българска народна банка

(млн. лв.)

ПАСИВИ НА ИНВЕСТИЦИОННИТЕ ФОНДОВЕ	Институционален сектор по ЕСС'95	31.12.2008 г.			31.03.2009 г.			30.06.2009 г.			30.09.2009 г.			31.12.2009 г.		
		ОБЩО	Рези- денти	Нерези- денти	ОБЩО	Рези- денти	Нерези- денти	ОБЩО	Рези- денти	Нерези- денти	ОБЩО	Рези- денти	Нерези- денти	ОБЩО	Рези- денти	Нерези- денти
ИНВЕСТИЦИОННИ ФОНДОВЕ - ОБЩО		455.7	427.0	28.7	439.8	411.4	28.4	466.3	439.1	27.2	558.9	527.0	31.8	608.5	576.2	32.3
<i>Чуждестранни инвестиционни фондове</i>		169.5	169.5		165.4	165.4		178.1	178.1		233.6	233.6		292.5	292.5	
<i>Местни инвестиционни фондове</i>		286.2	257.5	28.7	274.4	245.9	28.4	288.2	261.0	27.2	325.2	293.4	31.8	316.0	283.7	32.3
ЧУЖДЕСТРАННИ ИНВЕСТИЦИОННИ ФОНДОВЕ		169.5	169.5		165.4	165.4		178.1	178.1		233.6	233.6		292.5	292.5	
<i>Нефинансови предприятия</i>	(S.11)	4.1	4.1		12.2	12.2		4.0	4.0		4.4	4.4		4.9	4.9	
<i>Други ПФИ</i>	(S.122)	2.0	2.0		1.8	1.8		1.9	1.9		1.9	1.9		1.9	1.9	
<i>Други финансови посредници</i>	(S.123)	6.3	6.3		6.4	6.4		8.2	8.2		13.2	13.2		16.1	16.1	
<i>Финансови предприятия със спомагателна дейност</i>	(S.124)	0.0	0.0		0.0	0.0		0.2	0.2		5.7	5.7		12.3	12.3	
<i>Застрахователни компании и пенсионни фондове</i>	(S.125)	89.2	89.2		76.6	76.6		81.8	81.8		113.1	113.1		137.6	137.6	
<i>Домакинства и НТООД</i>	(S.14 + S.15)	67.9	67.9		68.3	68.3		82.1	82.1		95.4	95.4		119.7	119.7	
МЕСТНИ ИНВЕСТИЦИОННИ ФОНДОВЕ		286.2	257.5	28.7	274.4	245.9	28.4	288.2	261.0	27.2	325.2	293.4	31.8	316.0	283.7	32.3
Собствен капитал		285.0	256.3	28.7	271.3	242.9	28.4	287.5	260.3	27.2	323.9	292.1	31.8	315.2	282.9	32.3
<i>Нефинансови предприятия</i>	(S.11)	54.5	51.5	2.9	75.7	67.9	7.8	66.3	61.0	5.3	72.2	65.0	7.2	75.0	66.4	8.6
<i>Други ПФИ</i>	(S.122)	35.9	17.2	18.7	34.6	17.3	17.2	36.8	18.7	18.1	40.8	20.6	20.3	41.0	21.4	19.6
<i>Други финансови посредници</i>	(S.123)	0.6	0.6	0.0	1.1	1.1	0.0	1.2	1.2	0.0	1.3	1.3	0.0	1.4	1.4	0.0
<i>Финансови предприятия със спомагателна дейност</i>	(S.124)	6.1	6.1	0.0	7.6	7.6	0.0	7.9	7.9	0.0	8.7	8.7	0.0	8.4	8.4	0.0
<i>Застрахователни компании и пенсионни фондове</i>	(S.125)	31.1	31.1	0.0	47.2	47.2	0.0	63.4	63.4	0.0	73.8	73.0	0.8	70.8	69.7	1.0
<i>Домакинства и НТООД</i>	(S.14 + S.15)	156.8	149.8	7.0	105.2	101.8	3.4	111.8	108.0	3.8	127.1	123.4	3.7	118.6	115.6	3.0
Заеми		0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Финансови деривати		0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
Други		1.1	1.1	0.0	3.0	3.0	0.0	0.7	0.7	0.0	1.3	1.3	0.0	0.8	0.8	0.0

Източник: При местните инвестиционни фондове данните се събират от управляващите дружества, инвестиционните дружества от затворен тип и Централния депозитар. При чуждестранните инвестиционни фондове, данните обхващат пасивите на чуждестранни инвестиционни фондове към местни лица, като източник на информация са местните инвестиционни посредници и банките.
Предварителни данни.