

Брокерский отчет

ООО "Компания БКС"

Период: с 02.04.2018 по 02.04.2018
Клиент: Коммандитное товарищество"АБ ТРАСТ и Компания"
Генеральное соглашение:
Субсчет:

1. Движение денежных средств

1.1. Движение денежных средств по совершенным сделкам:

1.1.1. Движение денежных средств по совершенным сделкам (иным операциям) с ценными бумагами, а также по срочным сделкам:

| | |
|---|--------|
| Остаток денежных средств на начало периода (USD): | 162,00 |
| Остаток денежных средств на конец периода (USD): | 162,00 |

| | |
|---|-----------|
| Остаток денежных средств на начало периода (Рубль): | 52 762,61 |
| в т.ч. гарантийное обеспечение: | 10 160,00 |
| из них в "Овернайт ГО" передано (*****): | 0,00 |

| | |
|--|-----------|
| Остаток денежных средств на конец периода (Рубль): | 53 797,68 |
| в т.ч. гарантийное обеспечение: | 10 020,00 |
| из них в "Овернайт ГО" передано (*****): | 0,00 |

Рубль

| Дата | Операция | Сумма зачисления | Сумма списания | В т.ч.НДС (руб.) | Остаток (+/-) | в т.ч. гарант. обеспечение | в т.ч. депозитная маржа | Площадка | Примечание | Промежуточный клиринг (FORTS) |
|------------------------|--|------------------|----------------|------------------|---------------|----------------------------|-------------------------|----------------|------------|-------------------------------|
| 02.04.18 | Комиссия за займы "овернайт ЦБ" | | 0,02 | | | | | ММББ | | |
| 02.04.18 | Проценты по займам "овернайт ЦБ" | 0,09 | | | | | | ММББ | | |
| 02.04.18 | Вариаци. маржа по операциям с фьючерсами | 1 035,00 | | | | | | МосБирж(FORTS) | | |
| 02.04.18 | Вариационная маржа (пром. клиринг) | | | | | | | МосБирж(FORTS) | | -175,00 |
| 02.04.18 | Гарантийное обеспечение | | | | | -140,00 | | МосБирж(FORTS) | | 10 190,00 |
| 02.04.18 | Итого: | 1 035,09 | 0,02 | | 53 797,68 | 10 020,00 | | | | |
| Итого по валюте Рубль: | | 1 035,09 | 0,02 | | 53 797,68 | 10 020,00 | | | | |

"-" - задолженность клиента перед компанией

1.3. Удержанные сборы/штрафы (итоговые суммы):

Рубль

| Вид сбора/штрафа | Сумма списания | В т.ч.НДС (руб.) | Площадка |
|---------------------------------|----------------|------------------|----------|
| Комиссия за займы "овернайт ЦБ" | 0,02 | | ММББ |
| Итого по валюте Рубль: | 0,02 | | |

2.1. Сделки:

Займы "Овернайт ЦБ":

| Дата | Номер | Время | ЦБ | Срок (дней) | Ставка, % | Расход (шт.) (сумма займа) | Сумма %, руб. | Приход (шт.) (сумма займа) | Сумма %, руб. | Место сделки | Дата соверш. | Поставка (план) | Поставка (факт) |
|----------|------------------------|----------|--------------|-------------|-----------|----------------------------|---------------|----------------------------|---------------|--------------|--------------|-----------------|-----------------|
| 02.04.18 | 201803305GAZP2-0/01-27 | | GAZP2 | | 0,01 | | | 500 | 0,06 | Внебирж. | 30.03.18 | 02.04.18 | 02.04.18 |
| 02.04.18 | 201803305SU26205RMFS | | SU26205RMFS3 | | 0,01 | | | 37 | 0,03 | Внебирж. | 30.03.18 | 02.04.18 | 02.04.18 |
| 02.04.18 | 201804025SU26205RMFS | 17:29:59 | SU26205RMFS3 | | 0,01 | 160 | | | | Внебирж. | 02.04.18 | 02.04.18 | 02.04.18 |
| 02.04.18 | 201804025SU26205RMFS | | SU26205RMFS3 | | 0,01 | | | 160 | | Внебирж. | 02.04.18 | 02.04.18 | 02.04.18 |
| 02.04.18 | 201804025SU26205RMFS | 21:00:01 | SU26205RMFS3 | 1 | 0,01 | 160 | | | | Внебирж. | 02.04.18 | 02.04.18 | 02.04.18 |
| Итого: | | | | | | | | | 0,09 | | | | |

Инструменты срочного рынка МосБирж(FORTS)

Валюта = Рубль

| Дата | Номер сделки | Время | Откр.позиции на начало | Куплено, шт | Цена | Продано, шт | Цена | Откр.позиции на конец | Вариационная маржа | Тип | Дата соверш. | Время соверш. | Место сделки |
|--|--------------|-------|------------------------|-------------|------|-------------|------|-----------------------|--------------------|-----|--------------|---------------|----------------|
| GAZR-6.18 | | | | | | | | | | | | | |
| 02.04.18 | | | | -5 | | | | -5 | 1 035,00 | | | | МосБирж(FORTS) |
| Итого по GAZR-6.18: | | | | | | | | | 1 035,00 | | | | |
| Итого по фьючерсам и срочным контрактам: | | | | | | | | | 1 035,00 | | | | |

2.3. Незавершенные сделки

Займы "Овернайт ЦБ":

| Дата | Номер | ЦБ | Срок (дней) | Ставка, % | Расход (шт.) (сумма займа) | Сумма %, руб. | Приход (шт.) (сумма займа) | Сумма %, руб. | Место сделки | Дата соверш. | Время соверш. | Поставка (план) |
|----------|----------------------|--------------|-------------|-----------|----------------------------|---------------|----------------------------|---------------|--------------|--------------|---------------|-----------------|
| 02.04.18 | 201804025SU26205RMFS | SU26205RMFS3 | 1 | 0,01 | | | 160 | 0,05 | Внебирж. | 02.04.18 | 21:00:01 | 03.04.18 |
| Итого: | | | | | | | | 0,05 | | | | |

3. Активы:

| на начало периода | | | на конец периода | | |
|-------------------------------|----------|---------------------------|------------------|---------------------------|-------------------------------------|
| Портфель (итого) | В валюте | В рублях (по курсу ЦБ РФ) | В валюте | В рублях (по курсу ЦБ РФ) | Изменение стоимости портфеля (руб.) |
| Обязательства клиента (Рубль) | 0,09 | 0,09 | -19,00 | -19,00 | |

| | | | | | |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|---------------|
| Портфель по срочным контрактам (Рубль) | 38 678,72 | 38 678,72 | 39 713,72 | 39 713,72 | |
| Портфель по ценным бумагам (Рубль) | 658 122,09 | 658 122,09 | 657 285,76 | 657 285,76 | |
| Итого (Рубль): | 696 800,90 | 696 800,90 | 696 980,48 | 696 980,48 | 179,58 |
| Портфель по ценным бумагам (USD) | 162,00 | 9 357,54 | 162,00 | 9 276,91 | |
| Итого (USD): | 162,00 | 9 357,54 | 162,00 | 9 276,91 | -80,63 |
| Стоимость портфеля (руб.): | | 706 158,44 | | 706 257,39 | 98,95 |

| | | |
|--------------|------------|------------|
| Курсы валют: | 30.03.2018 | 02.04.2018 |
| USD | 57.7626 | 57.2649 |

| Портфель по ценным бумагам на начало периода | | | | | | | на конец периода | | | | | | |
|--|--------------|-----------------|---------------------|--|---------------|-------------------|---------------------|--|-----------------|-------------------|-----------------------|----------------|---------------------------------|
| Вид актива | ISIN | Тип ЦБ (№ вып.) | Кол-во ценных бумаг | Цена закрытия/ котировка вторич. ***** | Сумма НКД | Сумма, в т.ч. НКД | Кол-во ценных бумаг | Цена закрытия/ котировка вторич. ***** | Сумма НКД | Сумма, в т.ч. НКД | Организатор торгов ** | Место хранения | Эмитент |
| Рубль | | | | | | 14 083,99 | | | | 14 083,96 | ММВБ | | |
| FXMM_RM | IE00BL3DYX33 | Плай | 50 | 1 422,200000 | | 71 110,00 | 50 | 1 422,500000 | | 71 125,00 | ММВБ | Торг. (НРД) | FinEx Investment Management LLP |
| SU26205RMFS3 | RU000A0JREQ7 | Обл. | 123 | 103,500000 % | 4 174,62 | 131 479,62 | | | | | ММВБ | Торг. (НРД) | Минфин России |
| SU26205RMFS3 (в пути) | RU000A0JREQ7 | Обл. | 37 | 103,500000 % | 1 255,78 | 39 550,78 | 160 | 103,425000 % | 5 531,20 | 171 011,20 | ММВБ | Торг. (НРД) | Минфин России |
| SU26214RMFS5 | RU000A0JTYA5 | Обл. | 160 | 100,380000 % | 3 393,60 | 164 001,60 | 160 | 100,400000 % | 3 478,40 | 164 118,40 | ММВБ | Торг. (НРД) | Минфин России |
| SU26217RMFS8 | RU000A0JVW30 | Обл. | 160 | 103,447000 % | 1 216,00 | 166 731,20 | 160 | 103,420000 % | 1 315,20 | 166 787,20 | ММВБ | Торг. (НРД) | Минфин России |
| GAZP2 | RU0007661625 | АО (2) | | | | | 500 | 140,320000 | | 70 160,00 | ММВБ | Торг. (НРД) | ПАО "Газпром" |
| GAZP2 (в пути) | RU0007661625 | АО (2) | 500 | 142,330000 | | 71 165,00 | | | | | ММВБ | Торг. (НРД) | ПАО "Газпром" |
| Итого: | | | | | 10 040 | 658 122,09 | | | 10 324,8 | 657 285,76 | | | |

| Портфель по ценным бумагам на начало периода | | | | | | | на конец периода | | | | | | |
|--|------|-----------------|---------------------|--|-----------|-------------------|---------------------|--|-----------|-------------------|-----------------------|----------------|---------|
| Вид актива | ISIN | Тип ЦБ (№ вып.) | Кол-во ценных бумаг | Цена закрытия/ котировка вторич. ***** | Сумма НКД | Сумма, в т.ч. НКД | Кол-во ценных бумаг | Цена закрытия/ котировка вторич. ***** | Сумма НКД | Сумма, в т.ч. НКД | Организатор торгов ** | Место хранения | Эмитент |
| USD | | | | | | 162,00 | | | | 162,00 | ММВБ | | |
| Итого: | | | | | | 162,00 | | | | 162,00 | | | |

| Портфель по срочным контрактам(Рубль) | | | | на начало периода | | | | | на конец периода | | | | | |
|---------------------------------------|---------------|-----|-----------------|-------------------|----------------|-----------------------|---|---|------------------|----------------|-----------------------|---|---|----------------|
| Вид актива | Вид контракта | Тип | Цена исполнения | Кол-во | Расчетная цена | Средневзвешенная цена | Сумма, переданная в "Овернайт ГО" из Рубль (ГО) (*****) | Сумма / Сумма(*****)(включая Сумму, переданную в "Овернайт ГО" из Рубль (ГО)) | Кол-во | Расчетная цена | Средневзвешенная цена | Сумма, переданная в "Овернайт ГО" из Рубль (ГО) (*****) | Сумма / Сумма(*****)(включая Сумму, переданную в "Овернайт ГО" из Рубль (ГО)) | Площадка |
| Рубль | | | | | | | | 28 518,72 | | | | | 29 693,72 | МосБирж(FORTS) |
| Рубль (ГО), в т.ч. МосБирж(FORTS) | | | | | | | | 10 160,00 | | | | | 10 020,00 | МосБирж(FORTS) |
| GAZR-6.18 | Фьючерс | | | -5 | 14 508,000000 | | | | -5 | 14 301,000000 | | | | МосБирж(FORTS) |
| Итого: | | | | | | | | 38 678,72 | | | | | 39 713,72 | |

| Обязательства клиента на начало периода | | | | на конец периода | |
|---|--------------------|-------|-------------|------------------|--|
| | Организатор торгов | Сумма | Сумма | | |
| ПО (Рубль) | МосБирж(FORTS) | | | -19,05 | |
| По займам "Овернайт ЦБ" (Рубль) | ММВБ | | 0,09 | 0,05 | |
| Итого (Рубль): | | | 0,09 | -19,00 | |

4. Движение Ценных бумаг

| ЦБ | Дата | Остаток на начало дня / начало операции | Приход | Расход | Остаток на конец дня / конец операции | Место хранения | Примечание |
|--------------|----------|---|--------|--------|---------------------------------------|-----------------------|--------------------------------|
| GAZP2 | 02.04.18 | | 500 | | 500 | Торговый раздел (НРД) | 201803305GAZP2-0/01-2721 |
| SU26205RMFS3 | 02.04.18 | 123 | 37 | | 160 | Торговый раздел (НРД) | 201803305SU26205RMFS3-0/01-57 |
| SU26205RMFS3 | 02.04.18 | 160 | | 160 | | Торговый раздел (НРД) | 201804025SU26205RMFS3-0/01-57 |
| SU26205RMFS3 | 02.04.18 | | 160 | 160 | | Торговый раздел (НРД) | 201804025SU26205RMFS3-0/01d-57 |
| SU26214RMFS5 | 02.04.18 | 160 | | | 160 | Торговый раздел (НРД) | |
| SU26217RMFS8 | 02.04.18 | 160 | | | 160 | Торговый раздел (НРД) | |
| FXMM_RM | 02.04.18 | 50 | | | 50 | Торговый раздел (НРД) | |

(*) - оплата проводится со своего (клиента) счета
(**) - организатор торгов, по рыночной цене которого производится оценка
(***) - валюта договора (начальная цена, окончательная расчетная цена, сумма к возврату по расторжению, цена поставки актива)
(****) - Под Распределением понимается списание/зачисление денежных средств, являющихся возможным распределением на ценные бумаги в соответствии с Регламентом оказания услуг на рынке ценных бумаг ООО "Компания БКС"
(*****) - оценка паев, находящихся на основном разделе МСД, производится по котировке на продажу внебиржевого вторичного рынка
(*****) - знак " / " используется в значении " и (или)"
(*****) - сделка РЕПО со сроком исполнения второй части, определяемым по моменту востребования
(*****) - совершение договора займа "Овернайт ГО" не влечет изменения размера внесенного Клиентом гарантийного обеспечения
(*****) - "Сумма, переданная в "Овернайт ГО" из Рубль (ГО)" , "Сумма (включая Сумму, переданную в "Овернайт ГО" из Рубль (ГО))" указывается только в отношении строки "Рубль ГО, в т.ч. МосБирж(FORTS)". "Сумма, переданная в "Овернайт ГО" из Рубль (ГО)" означает сумму денежных средств, внесенных клиентом в качестве гарантийного обеспечения и переданную в займ "Овернайт ГО". "Сумма (включая Сумму, переданную в "Овернайт ГО" из Рубль (ГО))" означает размер требуемого гарантийного обеспечения, в том числе, денежные средства, которые внесены в качестве гарантийного обеспечения и переданы в займ "Овернайт ГО".
(*****) - Сумма %- Проценты (в рублях) за пользование Денежными средствами/Ценными бумагами по договору займа начисленные со дня, следующего за днем передачи Заемщику Денежных средств/Ценных Бумаг до дня Планового возврата Денежных средств/Ценных Бумаг
(*****) - указаны новые условия изменяемого договора

Дата составления отчета: 03.04.2018

_____/Карасев О.В./

Отчет получен _____