

Брокерский отчет

ООО "Компания БКС"

Период: с 30.07.2018 по 30.07.2018
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):	6 317,10
в т.ч. гарантийное обеспечение:	4 894,50
из них в "Овернайт ГО" передано (*****):	0,00

Остаток денежных средств на конец периода (Рубль):	73 461,38
в т.ч. гарантийное обеспечение:	4 862,37
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)
30.07.18	Комиссия за займы "овернайт ЦБ"		0,01					ММВБ		
30.07.18	Проценты по займам "овернайт ЦБ"	0,01						ММВБ		
30.07.18	Займы "овернайт"	28 000,00						ММВБ		
30.07.18	Проценты по займам "овернайт"	0,12						ММВБ		
30.07.18	Займы "овернайт"	39 000,00						МосБирж(FORTS)		
30.07.18	Проценты по займам "овернайт"	0,16						МосБирж(FORTS)		
30.07.18	Вариан. маржа по операциям с фьючерсами	144,00						МосБирж(FORTS)		
30.07.18	Вариационная маржа (пром. клиринг)							МосБирж(FORTS)		42,00
30.07.18	Гарантийное обеспечение					-32,13		МосБирж(FORTS)		4 874,03
30.07.18	Итого:	67 144,29	0,01		73 461,38	4 862,37				
Итого по валюте Рубль:		67 144,29	0,01		73 461,38	4 862,37				

"-" - задолженность клиента перед компанией

1.2. Займы:

1.2.1. Займы "Овернайт"/"Овернайт ГО":

Рубль

Дата	Движение	Срок (дней)	Ставка, %	Расход (сумма займа)	Сумма %, руб.	Приход (сумма займа)	Сумма %, руб.	Место сделки	Совершена	Состояние
30.07.18	Возврат		0,05			28 000,00	0,12	ММВБ	27.07.18	
30.07.18	Возврат		0,05			39 000,00	0,16	МосБирж(FORTS)	27.07.18	
Итого по валюте Рубль:						67 000,00	0,28			

1.3. Удержанные сборы/штрафы (итоговые суммы):

Рубль

Вид сбора/штрафа	Сумма списания	В т.ч.НДС (руб.)	Площадка
Комиссия за займы "овернайт ЦБ"	0,01		ММВБ
Итого по валюте Рубль:		0,01	

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)
30.07.18	201807275SU26216RMFS0		SU26216RMFS0		0,01			10	0,01	Внебирж.	27.07.18	30.07.18	30.07.18
30.07.18	201807305MTSS-0/01-d-19	17:29:59	MTSS		0,01	200				Внебирж.	30.07.18	30.07.18	30.07.18
30.07.18	201807305SU26217RMFS8	17:29:59	SU26217RMFS8		0,01	160				Внебирж.	30.07.18	30.07.18	30.07.18
30.07.18	201807305MTSS-0/01-d-19		MTSS		0,01			200		Внебирж.	30.07.18	30.07.18	30.07.18
30.07.18	201807305SU26217RMFS8		SU26217RMFS8		0,01			160		Внебирж.	30.07.18	30.07.18	30.07.18
30.07.18	201807305MTSS-0/01-168	21:00:01	MTSS	1	0,01	200				Внебирж.	30.07.18	30.07.18	30.07.18
30.07.18	201807305SU26216RMFS0	21:00:01	SU26216RMFS0	1	0,01	10				Внебирж.	30.07.18	30.07.18	30.07.18

30.07.18	201807305SU26217RMFS	21:00:01	SU26217RMFS	1	0,01	160				Внебирж.	30.07.18	30.07.18	30.07.18
Итого:										0,01			

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
MTSI-9.18													
30.07.18			-1					-1	144,00				МосБирж(FORTS)
Итого по MTSI-9.18:									144,00				
Итого по фьючерсам и срочным контрактам:									144,00				

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)
30.07.18	201807305MTSS-0/01-168	MTSS	1	0,01			200	0,01	Внебирж.	30.07.18	21:00:01	31.07.18
30.07.18	201807305SU26216RMFS	SU26216RMFS	1	0,01			10	0,01	Внебирж.	30.07.18	21:00:01	31.07.18
30.07.18	201807305SU26217RMFS	SU26217RMFS	1	0,01			160	0,04	Внебирж.	30.07.18	21:00:01	31.07.18
Итого:									0,06			

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)	66 573,05	66 573,05	-445,36	-445,36	
Портфель по срочным контрактам (Рубль)	5 860,85	5 860,85	45 005,01	45 005,01	
Портфель по ценным бумагам (Рубль)	626 553,75	626 553,75	654 337,37	654 337,37	
Итого (Рубль):	698 987,65	698 987,65	698 897,02	698 897,02	-90,63
Портфель по ценным бумагам (USD)	162,00	10 197,43	162,00	10 201,56	
Итого (USD):	162,00	10 197,43	162,00	10 201,56	4,13
Стоимость портфеля (руб.):		709 185,08		709 098,58	-86,50

Курсы валют:	27.07.2018	30.07.2018
USD	62,9471	62,9726

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						456,25				28 456,37	ММББ			
FXMM_RM	IE00BL3DYX33	Пай	50	1 446,100000		72 305,00	50	1 446,100000		72 305,00	ММББ	Торп.(НРД)	FinEx Investment Management LLP	
SU26205RMFS3	RU000A0JREQ7	Обл.	160	100,947000 %	3 331,20	164 846,40	160	100,900000 %	3 432,00	164 872,00	ММББ	Торп.(НРД)	Минфин России	
SU26214RMFS5	RU000A0JTYA5	Обл.	160	98,801000 %	1 627,20	159 708,80	160	98,906000 %	1 712,00	159 961,60	ММББ	Торп.(НРД)	Минфин России	
SU26216RMFS0 (в пути)	RU000A0JU9V1	Обл.	10	99,855000 %	132,20	10 117,70	10	99,835000 %	137,70	10 121,20	ММББ	Торп.(НРД)	Минфин России	
SU26217RMFS8	RU000A0JVV30	Обл.	160	100,750000 %	5 129,60	166 329,60					ММББ	Торп.(НРД)	Минфин России	
SU26217RMFS8 (в пути)	RU000A0JVV30	Обл.					160	100,640000 %	5 227,20	166 251,20	ММББ	Торп.(НРД)	Минфин России	
MTSS	RU0007775219	АО (1)	200	263,950000		52 790,00					ММББ	Торп.(НРД)	ПАО "МТС"	
MTSS (в пути)	RU0007775219	АО (1)					200	261,850000		52 370,00	ММББ	Торп.(НРД)	ПАО "МТС"	
Итого:					10 220,2	626 553,75			10 508,9	654 337,37				

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								966,35					40 142,64	МосБирж(FORTS)
Рубль (ГО), в т.ч. МосБирж(FORTS)								4 894,50					4 862,37	МосБирж(FORTS)
MTSI-9.18	Фьючерс			-1	26 532,000000				-1	26 388,000000				МосБирж(FORTS)
Итого:								5 860,85					45 005,01	

Обязательства клиента

на начало периода

на конец периода

	Организатор торгов	Сумма	Сумма
Ведение аналитического счета (Рубль)	МосБирж(FORTS)	-100,00	-100,00
Вознаграждение компании (Рубль)	ММББ	-118,76	-135,89
ПО (Рубль)	МосБирж(FORTS)	-208,48	-209,53
По займам "Овернайт ЦБ" (Рубль)	ММББ	0,01	0,06
По займам "Овернайт" (Рубль)	МосБирж(FORTS)	39 000,16	
По займам "Овернайт" (Рубль)	ММББ	28 000,12	
Итого (Рубль):		66 573,05	-445,36

4. Движение Ценных бумаг

ЦБ	Дата	Остаток на начало дня / начало операции	Приход	Расход	Остаток на конец дня / конец операции	Место хранения	Примечание
MTSS	30.07.18	200		200		Торговый раздел (НРД)	201807305MTSS-0/01-1688
MTSS	30.07.18		200	200		Торговый раздел (НРД)	201807305MTSS-0/01d-1988
SU26205RMFS3	30.07.18	160			160	Торговый раздел (НРД)	
SU26214RMFS5	30.07.18	160			160	Торговый раздел (НРД)	
SU26216RMFS0	30.07.18		10		10	Торговый раздел (НРД)	201807275SU26216RMFS0-0/01-431
SU26216RMFS0	30.07.18	10		10		Торговый раздел (НРД)	201807305SU26216RMFS0-0/01-431
SU26217RMFS8	30.07.18	160		160		Торговый раздел (НРД)	201807305SU26217RMFS8-0/01-175
SU26217RMFS8	30.07.18		160	160		Торговый раздел (НРД)	201807305SU26217RMFS8-0/01d-175
FXMM_RM	30.07.18	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: 31.07.2018

_____/Карасев О.В./

Отчет получен _____