

Брокерский отчет

ООО "Компания БКС"

Период:

с 18.09.2018 по 18.09.2018

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):	5 318,01
в т.ч. гарантийное обеспечение:	4 735,98
из них в "Овернайт ГО" передано (*****):	0,00

Остаток денежных средств на конец периода (Рубль):	5 103,14
в т.ч. гарантийное обеспечение:	4 769,82
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)
18.09.18	Комиссия за займы "овернайт ЦБ"		0,02					ММВБ		
18.09.18	Проценты по займам "овернайт ЦБ"	0,05						ММВБ		
18.09.18	Займы "овернайт"	34 000,00	34 000,00					ММВБ		
18.09.18	Проценты по займам "овернайт"	0,05						ММВБ		
18.09.18	Займы "овернайт"	38 000,00	38 000,00					МосБирж(FORTS)		
18.09.18	Проценты по займам "овернайт"	0,05						МосБирж(FORTS)		
18.09.18	Вариант маржа по операциям с фьючерсами		215,00					МосБирж(FORTS)		
18.09.18	Вариационная маржа (пром. клиринг)							МосБирж(FORTS)		338,00
18.09.18	Гарантийное обеспечение					33,84		МосБирж(FORTS)		4 665,58
18.09.18	Итого:	72 000,15	72 215,02		5 103,14	4 769,82				
Итого по валюте Рубль:		72 000,15	72 215,02		5 103,14	4 769,82				

"-" - 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
18.09.18	Возврат		0,05			34 000,00	0,05	ММВБ	17.09.18	
18.09.18	Возврат		0,05			38 000,00	0,05	МосБирж(FORTS)	17.09.18	
18.09.18	Займ	1	0,05	34 000,00				ММВБ		Не погашен
18.09.18	Займ	1	0,05	38 000,00				МосБирж(FORTS)		Не погашен
Итого по валюте Рубль:				72 000,00		72 000,00	0,10			

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		ММВБ
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)
18.09.18	201809175SU26214RMFS		SU26214RMFS5		0,01			160	0,04	Внебирж.	17.09.18	18.09.18	18.09.18
18.09.18	201809175SU26216RMFS		SU26216RMFS0		0,01			10	0,01	Внебирж.	17.09.18	18.09.18	18.09.18
18.09.18	201809185MTSS-0/01d-18	17:29:59	MTSS		0,01	200				Внебирж.	18.09.18	18.09.18	18.09.18
18.09.18	201809185SU26216RMFS	17:29:59	SU26216RMFS0		0,01	10				Внебирж.	18.09.18	18.09.18	18.09.18

18.09.18	201809185MTSS-0/01-d-18		MTSS			0,01			200	Внебирж.	18.09.18	18.09.18	18.09.18
18.09.18	201809185SU26216RMFS0		SU26216RMFS0			0,01			10	Внебирж.	18.09.18	18.09.18	18.09.18
18.09.18	201809185MTSS-0/01-158	21:00:01	MTSS		1	0,01	200			Внебирж.	18.09.18	18.09.18	18.09.18
18.09.18	201809185SU26216RMFS0	21:00:01	SU26216RMFS0		1	0,01	10			Внебирж.	18.09.18	18.09.18	18.09.18
Итого:									0,05				

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													
18.09.18			-1					-1	-215,00				МосБирж(FORTS)
Итого по MTSI-9.18:									-215,00				
Итого по фьючерсам и срочным контрактам:									-215,00				

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)
18.09.18	201809185MTSS-0/01-158	MTSS	1	0,01			200	0,02	Внебирж.	18.09.18	19:15:01	19.09.18
18.09.18	201809185SU26216RMFS0	SU26216RMFS0	1	0,01			10	0,01	Внебирж.	18.09.18	19:15:01	19.09.18
Итого:								0,03				

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)	71 780,15	71 780,15	71 760,13	71 760,13	
Портфель по срочным контрактам (Рубль)	5 016,99	5 016,99	4 802,04	4 802,04	
Портфель по ценным бумагам (Рубль)	620 420,82	620 420,82	621 598,50	621 598,50	
Итого (Рубль):	697 217,96	697 217,96	698 160,67	698 160,67	942,71
Портфель по ценным бумагам (USD)	162,00	11 061,78	162,00	11 047,72	
Итого (USD):	162,00	11 061,78	162,00	11 047,72	-14,06
Стоимость портфеля (руб.):		708 279,74		709 208,39	928,65

Курсы валют:	17.09.2018	18.09.2018
USD	68,2826	68,1958

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						301,02				301,10	ММВБ		
FXMM_RM	IE00BL3DYX33	Пай	50	1 455,800000		72 790,00	50	1 456,100000		72 805,00	ММВБ	Торг.(НРД)	FinEx Investment Management LLP
SU26205RMFS3	RU000A0JREQ7	Обл.	160	99,139000 %	5 064,00	163 686,40	160	99,250000 %	5 097,60	163 897,60	ММВБ	Торг.(НРД)	Минфин России
SU26214RMFS5	RU000A0JTYA5	Обл.					160	97,783000 %	3 113,60	159 566,40	ММВБ	Торг.(НРД)	Минфин России
SU26214RMFS5 (в пути)	RU000A0JTYA5	Обл.	160	97,625000 %	3 086,40	159 286,40					ММВБ	Торг.(НРД)	Минфин России
SU26216RMFS0 (в пути)	RU000A0JU9V1	Обл.	10	99,498000 %	227,60	10 177,40	10	99,529000 %	229,50	10 182,40	ММВБ	Торг.(НРД)	Минфин России
SU26217RMFS8	RU000A0JVW30	Обл.	160	98,747000 %	854,40	158 849,60	160	98,830000 %	888,00	159 016,00	ММВБ	Торг.(НРД)	Минфин России
MTSS	RU0007775219	АО (1)	200	276,650000		55 330,00					ММВБ	Торг.(НРД)	ПАО "МТС"
MTSS (в пути)	RU0007775219	АО (1)					200	279,150000		55 830,00	ММВБ	Торг.(НРД)	ПАО "МТС"
Итого:					9 232,4	620 420,82				9 328,7	621 598,50		

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								281,01					32,22	МосБирж(FORTS)
Рубль (ГО), в т.ч. МосБирж(FORTS)								4 735,98					4 769,82	МосБирж(FORTS)
MTSI-9.18	Фьючерс			-1	27 655,000000				-1	27 870,000000				МосБирж(FORTS)
Итого:								5 016,99					4 802,04	

Обязательства клиента		на начало периода	на конец периода
	Организатор торгов	Сумма	Сумма
ПО (Рубль)	МосБирж(FORTS)	-220,00	-240,00
По займам "Овернайт ЦБ" (Рубль)	ММББ	0,05	0,03
По займам "Овернайт" (Рубль)	МосБирж(FORTS)	38 000,05	38 000,05
По займам "Овернайт" (Рубль)	ММББ	34 000,05	34 000,05
Итого (Рубль):		71 780,15	71 760,13

4. Движение Ценных бумаг

ЦБ	Дата	Остаток на начало дня / начало операции	Приход	Расход	Остаток на конец дня / конец операции	Место хранения	Примечание
MTSS	18.09.18	200		200		Торговый раздел (НРД)	201809185MTSS-0/01-1562
MTSS	18.09.18		200	200		Торговый раздел (НРД)	201809185MTSS-0/01d-1831
SU26205RMFS3	18.09.18	160			160	Торговый раздел (НРД)	
SU26214RMFS5	18.09.18		160		160	Торговый раздел (НРД)	201809175SU26214RMFS5-0/01-209
SU26216RMFS0	18.09.18		10		10	Торговый раздел (НРД)	201809175SU26216RMFS0-0/01-544
SU26216RMFS0	18.09.18	10		10		Торговый раздел (НРД)	201809185SU26216RMFS0-0/01-547
SU26216RMFS0	18.09.18		10	10		Торговый раздел (НРД)	201809185SU26216RMFS0-0/01d-547
SU26217RMFS8	18.09.18	160			160	Торговый раздел (НРД)	
FXMM_RM	18.09.18	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))" указываеться 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: 19.09.2018
_____/Карасев О.В. Отчет получен _____