

Брокерский отчет

ООО "Компания БКС"

Период: с 27.03.2018 по 27.03.2018
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):	196 324,42
в т.ч. гарантийное обеспечение:	9 890,00
из них в "Овернайт ГО" передано (*****):	0,00

Остаток денежных средств на конец периода (Рубль):	195 079,50
в т.ч. гарантийное обеспечение:	10 060,00
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)
27.03.18	Комиссия за займы "овернайт ЦБ"		0,02					ММББ		
27.03.18	Проценты по займам "овернайт ЦБ"	0,10						ММББ		
27.03.18	Вариан. маржа по операциям с фьючерсами		1 245,00					МосБирж(FORTS)		
27.03.18	Вариационная маржа (пром. клиринг)							МосБирж(FORTS)		-755,00
27.03.18	Гарантийное обеспечение					170,00		МосБирж(FORTS)		10 000,00
27.03.18	Итого:	0,10	1 245,02		195 079,50	10 060,00				
Итого по валюте Рубль:		0,10	1 245,02		195 079,50	10 060,00				

"-" - 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)
27.03.18	201803265SU26205RMFS		SU26205RMFS3		0,01			160	0,05	Внебирж.	26.03.18	27.03.18	27.03.18
27.03.18	201803265SU26217RMFS		SU26217RMFS8		0,01			160	0,05	Внебирж.	26.03.18	27.03.18	27.03.18
Итого:									0,1				

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 мврга	Тип	Дата соверш.	Время соверш.	Место сделки
GAZR-6.18													
27.03.18				-5				-5	-1 245,00				МосБирж(FORTS)
Итого по GAZR-6.18:									-1 245,00				
Итого по фьючерсам и срочным контрактам:									-1 245,00				

2.3. Незавершенные сделки

Валюта цены = Рубль, валюта платежа = Рубль

Дата	Номер	Куплено, шт	Цена	Сумма по договору	Сумма платежа	НКД.Покупки	Продано, шт	Цена	Сумма по договору	Сумма платежа	НКД.Продажи	Тип сделки	Дата соверш.	Время соверш.	Оплата (план)	Поставка (план)	Место сделки
FXMM_RM		Номер per.:		ISIN: IE00BL3DYX33		FinEx Investment Management LLP											
26.03.18	2812188614	50	1 420,300000	71 015,00									26.03.18	14:19:52	28.03.18	28.03.18	ММББ
Итого по FXMM_RM:				71 015,00													
GAZP2		Номер per.:		1-02-00028-A		ISIN: RU0007661625		Публичное акционерное общество "Газпром"									
26.03.18	2812184796	500	140,590000	70 295,00									26.03.18	14:13:10	28.03.18	28.03.18	ММББ
Итого по GAZP2:				70 295,00													

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)	-141 550,64	-141 550,64	-141 569,79	-141 569,79	

Портфель по срочным контрактам (Рубль)	40 930,65	40 930,65	39 685,65	39 685,65	
Портфель по ценным бумагам (Рубль)	797 198,17	797 198,17	798 308,45	798 308,45	
Итого (Рубль):	696 578,18	696 578,18	696 424,31	696 424,31	-153,87
Портфель по ценным бумагам (USD)	162,00	9 251,37	162,00	9 234,63	
Итого (USD):	162,00	9 251,37	162,00	9 234,63	-16,74
Стоимость портфеля (руб.):		705 829,55		705 658,94	-170,61

Курсы валют:	26.03.2018	27.03.2018
USD	57,1072	57,0039

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						155 393,77				155 393,85	ММВБ		
FXMM_RM (в пути)	IE00BL3DYX33	Плай	50	1 420,300000		71 015,00		1 420,500000		71 025,00	ММВБ	Торг.(НРД)	FinEx Investment Management LLP
SU26205RMFS3	RU000A0JREQ7	Обл.					50	103,460000 %	5 331,20	170 867,20	ММВБ	Торг.(НРД)	Минфин России
SU26205RMFS3 (в пути)	RU000A0JREQ7	Обл.	160	103,497000 %	5 297,60	170 892,80					ММВБ	Торг.(НРД)	Минфин России
SU26214RMFS5	RU000A0JTYA5	Обл.	160	100,497000 %	3 281,60	164 076,80					ММВБ	Торг.(НРД)	Минфин России
SU26217RMFS8	RU000A0JVW30	Обл.					160	100,303000 %	3 310,40	163 795,20	ММВБ	Торг.(НРД)	Минфин России
SU26217RMFS8 (в пути)	RU000A0JVW30	Обл.	160	103,500000 %	1 084,80	166 684,80		103,568000 %	1 118,40	166 827,20	ММВБ	Торг.(НРД)	Минфин России
GAZP2 (в пути)	RU0007661625	АО (2)	500	138,270000		69 135,00	500	140,800000		70 400,00	ММВБ	Торг.(НРД)	ПАО "Газпром"
Итого:					9 664	797 198,17			9 760	798 308,45			

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								31 040,65					29 625,65	МосБирж(FORTS)
Рубль (ГО), в т.ч. МосБирж(FORTS)								9 890,00					10 060,00	МосБирж(FORTS)
GAZR-6.18	Фьючерс			-5	14 121,000000				-5	14 370,000000				МосБирж(FORTS)
Итого:								40 930,65					39 685,65	

Обязательства клиента на начало периода				на конец периода	
	Организатор торгов	Сумма	Сумма		
Ведение аналитического счета (Рубль)	МосБирж(FORTS)	-100,00	-100,00		
ПО (Рубль)	МосБирж(FORTS)	-140,74	-159,79		
По займам "Овернайт ЦБ" (Рубль)	ММВБ	0,10			
По сделкам (Рубль)	ММВБ	-141 310,00	-141 310,00		
Итого (Рубль):		-141 550,64	-141 569,79		

4. Движение Ценных бумаг

ЦБ	Дата	Остаток на начало дня / начало операции	Приход	Расход	Остаток на конец дня / конец операции	Место хранения	Примечание
SU26205RMFS3	27.03.18		160		160	Торговый раздел (НРД)	201803265SU26205RMFS3-0/01-56
SU26214RMFS5	27.03.18	160			160	Торговый раздел (НРД)	
SU26217RMFS8	27.03.18		160		160	Торговый раздел (НРД)	201803265SU26217RMFS8-0/01-133

(*) - 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