

Брокерский отчет

ООО "Компания БКС"

Период:

с 25.07.2018 по 25.07.2018

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):	6 349,68
в т.ч. гарантийное обеспечение:	4 903,72
из них в "Овернайт ГО" передано (*****):	0,00

Остаток денежных средств на конец периода (Рубль):	5 444,80
в т.ч. гарантийное обеспечение:	4 887,21
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)
25.07.18	Комиссия за займы "овернайт ЦБ"		0,02					ММВБ		
25.07.18	Проценты по займам "овернайт ЦБ"	0,05						ММВБ		
25.07.18	Займы "овернайт"	28 000,00	28 000,00					ММВБ		
25.07.18	Проценты по займам "овернайт"	0,04						ММВБ		
25.07.18	Займы "овернайт"	39 000,00	40 000,00					МосБирж(FORTS)		
25.07.18	Проценты по займам "овернайт"	0,05						МосБирж(FORTS)		
25.07.18	Вариаци. маржа по операциям с фьючерсами	95,00						МосБирж(FORTS)		
25.07.18	Вариационная маржа (пром. клиринг)							МосБирж(FORTS)		149,00
25.07.18	Гарантийное обеспечение					-16,51		МосБирж(FORTS)		4 866,65
25.07.18	Итого:	67 095,14	68 000,02		5 444,80	4 887,21				
Итого по валюте Рубль:		67 095,14	68 000,02		5 444,80	4 887,21				

"-" - 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
25.07.18	Возврат		0,05			28 000,00	0,04	ММВБ	24.07.18	
25.07.18	Возврат		0,05			39 000,00	0,05	МосБирж(FORTS)	24.07.18	
25.07.18	Займ	1	0,05	28 000,00				ММВБ		Не погашен
25.07.18	Займ	1	0,05	40 000,00				МосБирж(FORTS)		Не погашен
Итого по валюте Рубль:				68 000,00		67 000,00	0,09			

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)
25.07.18	20180724FSU26216RMFS		SU26216RMFS0		0,01			10	0,01	Внебирж.	24.07.18	25.07.18	25.07.18
25.07.18	20180724FSU26217RMFS		SU26217RMFS8		0,01			160	0,04	Внебирж.	24.07.18	25.07.18	25.07.18
25.07.18	20180725FSMTSS-0/01d-20	17:29:59	MTSS		0,01	200				Внебирж.	25.07.18	25.07.18	25.07.18
25.07.18	20180725FSU26205RMFS	17:29:59	SU26205RMFS3		0,01	76				Внебирж.	25.07.18	25.07.18	25.07.18
25.07.18	20180725FSU26216RMFS	17:29:59	SU26216RMFS0		0,01	10				Внебирж.	25.07.18	25.07.18	25.07.18
25.07.18	20180725FSMTSS-0/01d-20		MTSS					200		Внебирж.	25.07.18	25.07.18	25.07.18
25.07.18	20180725FSU26205RMFS		SU26205RMFS3		0,01			76		Внебирж.	25.07.18	25.07.18	25.07.18
25.07.18	20180725FSU26216RMFS		SU26216RMFS0		0,01			10		Внебирж.	25.07.18	25.07.18	25.07.18
25.07.18	20180725FSU26205RMFS	21:00:01	SU26205RMFS3	1	0,01	160				Внебирж.	25.07.18	25.07.18	25.07.18
25.07.18	20180725FSU26216RMFS	21:00:01	SU26216RMFS0	1	0,01	10				Внебирж.	25.07.18	25.07.18	25.07.18
25.07.18	20180725FSU26217RMFS	21:00:01	SU26217RMFS8	1	0,01	160				Внебирж.	25.07.18	25.07.18	25.07.18
Итого:													

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													
25.07.18			-1					-1	95,00				МосБирж(FORTS)
Итого по MTSI-9.18:									95,00				
Итого по фьючерсам и срочным контрактам:									95,00				

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)
25.07.18	201807255SU26205RMFS	SU26205RMFS3	1	0,01			160	0,04	Внебирж.	25.07.18	21:00:01	26.07.18
25.07.18	201807255SU26216RMFS	SU26216RMFS0	1	0,01			10	0,01	Внебирж.	25.07.18	21:00:01	26.07.18
25.07.18	201807255SU26217RMFS	SU26217RMFS8	1	0,01			160	0,04	Внебирж.	25.07.18	21:00:01	26.07.18
Итого:								0,09				

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)	66 627,45	66 627,45	67 609,31	67 609,31	
Портфель по срочным контрактам (Рубль)	5 893,70	5 893,70	4 988,75	4 988,75	
Портфель по ценным бумагам (Рубль)	626 716,28	626 716,28	626 280,55	626 280,55	
Итого (Рубль):	699 237,43	699 237,43	698 878,61	698 878,61	-358,82
Портфель по ценным бумагам (USD)	162,00	10 237,70	162,00	10 193,61	
Итого (USD):	162,00	10 237,70	162,00	10 193,61	-44,09
Стоимость портфеля (руб.):		709 475,13		709 072,22	-402,91

Курсы валют:	24.07.2018	25.07.2018
USD	63,1957	62,9235

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						455,98				456,05	ММВБ		
FXMM_RM	IE00BL3DYX33	Пай	50	1 445,500000		72 275,00	50	1 445,600000		72 280,00	ММВБ	Торг.(НРД)	FinEx Investment Management LLP
SU26205RMFS3	RU000A0JREQ7	Обл.	160	101,044000 %	3 232,00	164 902,40					ММВБ	Торг.(НРД)	Минфин России
SU26205RMFS3 (в пути)	RU000A0JREQ7	Обл.					160	100,999000 %	3 265,60	164 864,00	ММВБ	Торг.(НРД)	Минфин России
SU26214RMFS5	RU000A0JTYA5	Обл.	160	98,851000 %	1 542,40	159 704,00	160	98,849000 %	1 571,20	159 729,60	ММВБ	Торг.(НРД)	Минфин России
SU26216RMFS0 (в пути)	RU000A0JU9V1	Обл.	10	99,950000 %	126,70	10 121,70	10	99,856000 %	128,50	10 114,10	ММВБ	Торг.(НРД)	Минфин России
SU26217RMFS8 (в пути)	RU000A0JVV30	Обл.	160	100,948000 %	5 030,40	166 547,20	160	100,758000 %	5 064,00	166 276,80	ММВБ	Торг.(НРД)	Минфин России
MTSS	RU0007775219	АО (1)	200	263,550000		52 710,00	200	262,800000		52 560,00	ММВБ	Торг.(НРД)	ПАО "МТС"
Итого:					9 931,5	626 716,28			10 029,3	626 280,55			

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								989,98					101,54	МосБирж(FORTS)
Рубль (ГО), в т.ч. МосБирж(FORTS)								4 903,72					4 887,21	МосБирж(FORTS)
MTSI-9.18	Фьючерс			-1	26 499,000000				-1	26 404,000000				МосБирж(FORTS)
Итого:								5 893,70					4 988,75	

на начало периода		на конец периода	
	Организатор торгов	Сумма	Сумма
Ведение аналитического счета (Рубль)	МосБирж(FORTS)	-100,00	-100,00
Вознаграждение компании (Рубль)	ММВБ	-101,63	-107,34
ПО (Рубль)	МосБирж(FORTS)	-171,06	-183,53
По займам "Овернайт ЦБ" (Рубль)	ММВБ	0,05	0,09
По займам "Овернайт" (Рубль)	МосБирж(FORTS)	39 000,05	40 000,05
По займам "Овернайт" (Рубль)	ММВБ	28 000,04	28 000,04
Итого (Рубль):		66 627,45	67 609,31

4. Движение Ценных бумаг

ЦБ	Дата	Остаток на начало дня / начало операции	Приход	Расход	Остаток на конец дня / конец операции	Место хранения	Примечание
----	------	---	--------	--------	---------------------------------------	----------------	------------

MTSS	25.07.18		200	200	200	200	Торговый раздел (НРД)	201807255MTSS-0/01d-2009
SU26205RMFS3	25.07.18		160		160		Торговый раздел (НРД)	201807255SU26205RMFS3-0/01-66
SU26205RMFS3	25.07.18			76	76		Торговый раздел (НРД)	201807255SU26205RMFS3-0/01d-67
SU26214RMFS5	25.07.18		160			160	Торговый раздел (НРД)	
SU26216RMFS0	25.07.18			10		10	Торговый раздел (НРД)	201807245SU26216RMFS0-0/01-415
SU26216RMFS0	25.07.18		10		10		Торговый раздел (НРД)	201807255SU26216RMFS0-0/01-426
SU26216RMFS0	25.07.18			10	10		Торговый раздел (НРД)	201807255SU26216RMFS0-0/01d-426
SU26217RMFS8	25.07.18			160		160	Торговый раздел (НРД)	201807245SU26217RMFS8-0/01-175
SU26217RMFS8	25.07.18		160		160		Торговый раздел (НРД)	201807255SU26217RMFS8-0/01-174
FXMM_RM	25.07.18		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:26.07.2018

/Карасев О.В./

Отчет получен