

ООО "Компания БКС"

Период: с 20.08.2018 по 20.08.2018
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):	5 293,59
в т.ч. гарантийное обеспечение:	4 516,19
из них в "Овернайт ГО" передано (*****):	0,00

Остаток денежных средств на конец периода (Рубль):	74 258,00
в т.ч. гарантийное обеспечение:	4 502,68
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)
20.08.18	Комиссия за займы "овернайт ЦБ"		0,02					ММВБ		
20.08.18	Проценты по займам "овернайт ЦБ"	0,14						ММВБ		
20.08.18	Займы "овернайт"	28 000,00						ММВБ		
20.08.18	Проценты по займам "овернайт"	0,12						ММВБ		
20.08.18	Займы "овернайт"	41 000,00						МосБирж(FORTS)		
20.08.18	Проценты по займам "овернайт"	0,17						МосБирж(FORTS)		
20.08.18	Вариант. маржа по операциям с фьючерсами		36,00					МосБирж(FORTS)		
20.08.18	Вариационная маржа (пром. клиринг)							МосБирж(FORTS)		41,00
20.08.18	Гарантийное обеспечение					-13,51		МосБирж(FORTS)		4 489,15
20.08.18	Итого:	69 000,43	36,02		74 258,00	4 502,68				
Итого по валюте Рубль:		69 000,43	36,02		74 258,00	4 502,68				

"-" - 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
20.08.18	Возврат		0,05			28 000,00	0,12	ММББ	17.08.18	
20.08.18	Возврат		0,05			41 000,00	0,17	МосБирж(FORTS)	17.08.18	
Итого по валюте Рубль:						69 000,00	0,29			

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 (дни)	Ставка, %	Расход (шт.) (сумма займа)	Сумма %, руб.	Приход (шт.) (сумма займа)	Сумма %, руб.	Место сделки	Дата соверш.	Поставка (план)	Поставка (факт)
20.08.18	201808175SU26216RMFS		SU26216RMFS0		0,01			10	0,01	Внебирж.	17.08.18	20.08.18	20.08.18
20.08.18	201808175SU26217RMFS		SU26217RMFS8		0,01			160	0,13	Внебирж.	17.08.18	20.08.18	20.08.18
20.08.18	201808205MTSS-0/01d-19	17:29:59	MTSS		0,01	200				Внебирж.	20.08.18	20.08.18	20.08.18
20.08.18	201808205SU26216RMFS	17:29:59	SU26216RMFS0		0,01	10				Внебирж.	20.08.18	20.08.18	20.08.18
20.08.18	201808205SU26217RMFS	17:29:59	SU26217RMFS8		0,01	160				Внебирж.	20.08.18	20.08.18	20.08.18
20.08.18	201808205MTSS-0/01d-19		MTSS		0,01			200		Внебирж.	20.08.18	20.08.18	20.08.18
20.08.18	201808205SU26216RMFS		SU26216RMFS0		0,01			10		Внебирж.	20.08.18	20.08.18	20.08.18
20.08.18	201808205SU26217RMFS		SU26217RMFS8		0,01			160		Внебирж.	20.08.18	20.08.18	20.08.18
20.08.18	201808205SU26216RMFS	21:00:01	SU26216RMFS0	1	0,01	10				Внебирж.	20.08.18	20.08.18	20.08.18
20.08.18	201808205SU26217RMFS	21:00:01	SU26217RMFS8	1	0,01	160				Внебирж.	20.08.18	20.08.18	20.08.18
Итого:									0,14				

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												
20.08.18				-1					-1		-36,00	МосБирж(FORTS)
Итого по MTSI-9.18:											-36,00	
Итого по фьючерсам и срочным контрактам:											-36,00	

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)
20.08.18	201808205SU26216RMFS	SU26216RMFS0	1	0,01			10	0,01	Внебирж.	20.08.18	21:00:01	21.08.18
20.08.18	201808205SU26217RMFS	SU26217RMFS8	1	0,01			160	0,04	Внебирж.	20.08.18	21:00:01	21.08.18
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)		68 774,34		68 774,34		-243,43		-243,43				
Портфель по срочным контрактам (Рубль)		4 978,24		4 978,24		45 942,41		45 942,41				
Портфель по ценным бумагам (Рубль)		617 625,15		617 625,15		646 721,49		646 721,49				
Итого (Рубль):		691 377,73		691 377,73		692 420,47		692 420,47		1 042,74		
Портфель по ценным бумагам (USD)		162,00		10 836,70		162,00		10 833,86				
Итого (USD):		162,00		10 836,70		162,00		10 833,86		-2,84		
Стоимость портфеля (руб.):				702 214,43				703 254,33		1 039,90		

Курсы валют:	17.08.2018	20.08.2018
USD	66,8932	66,8757

Портфель по ценным бумагам

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						315,35				28 315,59	ММББ		
FXMM_RM	IE00BL3DYX33	Пай	50	1 450,700000		72 535,00	50	1 451,000000		72 550,00	ММББ	Торг.(НРД)	FinEx Investment Management LLP
SU26205RMFS3	RU000A0JREQ7	Обл.	160	99,387000 %	4 032,00	163 051,20	160	99,311000 %	4 131,20	163 028,80	ММББ	Торг.(НРД)	Минфин России
SU26214RMFS5	RU000A0JTYA5	Обл.	160	97,650000 %	2 216,00	158 456,00	160	97,899000 %	2 300,80	158 939,20	ММББ	Торг.(НРД)	Минфин России
SU26216RMFS0 (в пути)	RU000A0JU9V1	Обл.	10	99,525000 %	170,70	10 123,20	10	99,649000 %	176,20	10 141,10	ММББ	Торг.(НРД)	Минфин России
SU26217RMFS8 (в пути)	RU000A0JVW30	Обл.	160	98,497000 %	5 819,20	163 414,40	160	98,749000 %	5 918,40	163 916,80	ММББ	Торг.(НРД)	Минфин России
MTSS	RU0007775219	АО (1)	200	248,650000		49 730,00	200	249,150000		49 830,00	ММББ	Торг.(НРД)	ПАО "МТС"
Итого:					12 237,9	617 625,15			12 526,6	646 721,49			

Портфель по ценным бумагам

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	ММББ		
Итого:						162,00				162,00			

Портфель по срочным контрактам(Рубль)

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								462,05					41 439,73	МосБирж(FORTS)
Рубль (ГО), в т.ч. МосБирж(FORTS)								4 516,19					4 502,68	МосБирж(FORTS)
MTSI-9.18	Фьючерс				-1	25 093,000000			-1	25 129,000000				МосБирж(FORTS)
Итого:								4 978,24					45 942,41	

Обязательства клиента

на начало периода		на конец периода	
Организатор торгов	Сумма	Организатор торгов	Сумма
ПО (Рубль)	МосБирж(FORTS)	-226,09	-243,48
По займам "Овернайт ЦБ" (Рубль)	ММББ	0,14	0,05
По займам "Овернайт" (Рубль)	МосБирж(FORTS)	41 000,17	
По займам "Овернайт" (Рубль)	ММББ	28 000,12	
Итого (Рубль):		68 774,34	-243,43

4. Движение Ценных бумаг

ЦБ	Дата	Остаток на начало дня / начало операции	Приход	Расход	Остаток на конец дня / конец операции	Место хранения	Примечание
MTSS	20.08.18	200	200	200	200	Торговый раздел (НРД)	201808205MTSS-0/01d-1976
SU26205RMFS3	20.08.18	160			160	Торговый раздел (НРД)	
SU26214RMFS5	20.08.18	160			160	Торговый раздел (НРД)	
SU26216RMFS0	20.08.18		10		10	Торговый раздел (НРД)	201808175SU26216RMFS0-0/01-496
SU26216RMFS0	20.08.18	10		10		Торговый раздел (НРД)	201808205SU26216RMFS0-0/01-498

SU26216RMFS0	20.08.18		10	10		Торговый раздел (НРД)	201808205SU26216RMFS0-0/01d-499
SU26217RMFS8	20.08.18		160		160	Торговый раздел (НРД)	201808175SU26217RMFS8-0/01-179
SU26217RMFS8	20.08.18	160		160		Торговый раздел (НРД)	201808205SU26217RMFS8-0/01-182
SU26217RMFS8	20.08.18		160	160		Торговый раздел (НРД)	201808205SU26217RMFS8-0/01d-182
FXMM_RM	20.08.18	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:21.08.2018

/Карасев О.В./

Отчет получен