

Брокерский отчет

ООО "Компания БКС"

Период: с 10.08.2018 по 10.08.2018  
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): | 73 778,96 |
| в т.ч. гарантийное обеспечение:                     | 4 663,63  |
| из них в "Овернайт ГО" передано (*****):            | 0,00      |

|  |           |
|--|-----------|
| Остаток денежных средств на конец периода (Рубль): | 73 896,99 |
| в т.ч. гарантийное обеспечение:                    | 4 637,86  |
| 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) |
|------------------------|---|------------------|----------------|------------------|---------------|----------------------------|-------------------------|----------------|------------|-------------------------------|
| 10.08.18               | Комиссия за займы "овернайт ЦБ"         |                  | 0,02           |                  |               |                            |                         | ММВБ           |            |                               |
| 10.08.18               | Проценты по займам "овернайт ЦБ"        | 0,05             |                |                  |               |                            |                         | ММВБ           |            |                               |
| 10.08.18               | Вариан. маржа по операциям с фьючерсами | 118,00           |                |                  |               |                            |                         | МосБирж(FORTS) |            |                               |
| 10.08.18               | Вариационная маржа (пром. клиринг)      |                  |                |                  |               |                            |                         | МосБирж(FORTS) |            | -270,00                       |
| 10.08.18               | Гарантийное обеспечение                 |                  |                |                  |               | -25,77                     |                         | МосБирж(FORTS) |            | 4 703,09                      |
| 10.08.18               | Итого:                                  | 118,05           | 0,02           |                  | 73 896,99     | 4 637,86                   |                         |                |            |                               |
| Итого по валюте Рубль: |   | 118,05           | 0,02           |                  | 73 896,99     | 4 637,86                   |                         |                |            |                               |

"-" - 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           |                  | 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) |
|----------|------------------------|----------|--------------|-------------|-----------|----------------------------|---------------|----------------------------|---------------|--------------|--------------|-----------------|-----------------|
| 10.08.18 | 201808095MTSS-0/01-164 |          | MTSS         |             | 0,01      |                            |               | 200                        | 0,01          | Внебирж.     | 09.08.18     | 10.08.18        | 10.08.18        |
| 10.08.18 | 201808095SU26217RMFS8  |          | SU26217RMFS8 |             | 0,01      |                            |               | 160                        | 0,04          | Внебирж.     | 09.08.18     | 10.08.18        | 10.08.18        |
| 10.08.18 | 201808105MTSS-0/01d-19 | 17:29:59 | MTSS         |             | 0,01      | 200                        |               |                            |               | Внебирж.     | 10.08.18     | 10.08.18        | 10.08.18        |
| 10.08.18 | 201808105SU26205RMFS3  | 17:29:59 | SU26205RMFS3 |             | 0,01      | 160                        |               |                            |               | Внебирж.     | 10.08.18     | 10.08.18        | 10.08.18        |
| 10.08.18 | 201808105MTSS-0/01d-19 |          | MTSS         |             | 0,01      |                            |               | 200                        |               | Внебирж.     | 10.08.18     | 10.08.18        | 10.08.18        |
| 10.08.18 | 201808105SU26205RMFS3  |          | SU26205RMFS3 |             | 0,01      |                            |               | 160                        |               | Внебирж.     | 10.08.18     | 10.08.18        | 10.08.18        |
| 10.08.18 | 201808105MTSS-0/01-163 | 21:00:01 | MTSS         | 3           | 0,01      | 200                        |               |                            |               | Внебирж.     | 10.08.18     | 10.08.18        | 10.08.18        |
| 10.08.18 | 201808105SU26205RMFS3  | 21:00:01 | SU26205RMFS3 | 3           | 0,01      | 160                        |               |                            |               | Внебирж.     | 10.08.18     | 10.08.18        | 10.08.18        |
| 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                                |              |       |                        |             |      |             |      |                       |                    |     |              |               |                |
| 10.08.18                                 |              |       | -1                     |             |      |             |      | -1                    | 118,00             |     |              |               | МосБирж(FORTS) |
| Итого по MTSI-9.18:                      |              |       |                        |             |      |             |      |                       | 118,00             |     |              |               |                |
| Итого по фьючерсам и срочным контрактам: |              |       |                        |             |      |             |      |                       | 118,00             |     |              |               |                |

2.3. Незавершенные сделки

Займы "Овернайт ЦБ":

| Дата     | Номер                  | ЦБ           | Срок (дней) | Ставка, % | Расход (шт.)<br>(сумма займа) | Сумма %, руб. | Приход (шт.)<br>(сумма займа) | Сумма %, руб. | Место сделки | Дата соверш. | Время соверш. | Поставка (план) |
|----------|------------------------|--------------|-------------|-----------|-------------------------------|---------------|-------------------------------|---------------|--------------|--------------|---------------|-----------------|
| 10.08.18 | 201808105MTSS-0/01-163 | MTSS         | 3           | 0,01      |                               |               | 200                           | 0,04          | Внебирж.     | 10.08.18     | 21:00:01      | 13.08.18        |
| 10.08.18 | 201808105SU26205RMFS3  | SU26205RMFS3 | 3           | 0,01      |                               |               | 160                           | 0,13          | Внебирж.     | 10.08.18     | 21:00:01      | 13.08.18        |
| Итого:   |                        |              |             |           |                               |               |                               | 0,17          |              |              |               |                 |

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)          | -121,69    | -121,69                   | -138,96          | -138,96                   |                                     |
| Портфель по срочным контрактам (Рубль) | 45 464,06  | 45 464,06                 | 45 582,06        | 45 582,06                 |                                     |
| Портфель по ценным бумагам (Рубль)     | 649 308,90 | 649 308,90                | 648 707,93       | 648 707,93                |                                     |
| Итого (Рубль):                         | 694 651,27 | 694 651,27                | 694 151,03       | 694 151,03                | -500,24                             |
| Портфель по ценным бумагам (USD)       | 162,00     | 10 302,39                 | 162,00           | 10 738,27                 |                                     |
| Итого (USD):                           | 162,00     | 10 302,39                 | 162,00           | 10 738,27                 | 435,88                              |
| Стоимость портфеля (руб.):             |            | 704 953,66                |                  | 704 889,30                | -64,36                              |

|              |            |            |
|--------------|------------|------------|
| Курсы валют: | 09.08.2018 | 10.08.2018 |
| USD          | 63,5950    | 66,2856    |

| 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                      |              |                   |                     |                                       |           | 28 314,90         |                     |                                       |           | 28 314,93         | ММББ                  |                |                                 |
| FXMM_RM                    | IE00BL3DYX33 | Пай               | 50                  | 1 448,900000                          |           | 72 445,00         | 50                  | 1 449,400000                          |           | 72 470,00         | ММББ                  | Торп.(НРД)     | FinEx Investment Management LLP |
| SU26205RMFS3               | RU000A0JREQ7 | Обл.              | 160                 | 99,888000 %                           | 3 764,80  | 163 585,60        |                     |                                       |           |                   | ММББ                  | Торп.(НРД)     | Минфин России                   |
| SU26205RMFS3 (в пути)      | RU000A0JREQ7 | Обл.              |                     |                                       |           |                   | 160                 | 99,711000 %                           | 3 798,40  | 163 336,00        | ММББ                  | Торп.(НРД)     | Минфин России                   |
| SU26214RMFS5               | RU000A0JTYA5 | Обл.              | 160                 | 98,248000 %                           | 1 992,00  | 159 188,80        | 160                 | 98,075000 %                           | 2 019,20  | 158 939,20        | ММББ                  | Торп.(НРД)     | Минфин России                   |
| SU26216RMFS0               | RU000A0JU9V1 | Обл.              | 10                  | 99,690000 %                           | 156,00    | 10 125,00         | 10                  | 99,659000 %                           | 157,90    | 10 123,80         | ММББ                  | Торп.(НРД)     | Минфин России                   |
| SU26217RMFS8               | RU000A0JVW30 | Обл.              |                     |                                       |           |                   | 160                 | 99,497000 %                           | 5 588,80  | 164 784,00        | ММББ                  | Торп.(НРД)     | Минфин России                   |
| SU26217RMFS8 (в пути)      | RU000A0JVW30 | Обл.              | 160                 | 99,608000 %                           | 5 556,80  | 164 929,60        |                     |                                       |           |                   | ММББ                  | Торп.(НРД)     | Минфин России                   |
| MTSS (в пути)              | RU0007775219 | АО (1)            | 200                 | 253,600000                            |           | 50 720,00         | 200                 | 253,700000                            |           | 50 740,00         | ММББ                  | Торп.(НРД)     | ПАО "МТС"                       |
| Итого:                     |              |                   |                     |                                       | 11 469,6  | 649 308,90        |                     |                                       | 11 564,3  | 648 707,93        |                       |                |                                 |

| 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            |                       |                |         |

| 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                             |               |     |                 |        |                |                       |   | 40 800,43   |        |                |                       |   | 40 944,20   | МосБирж(FORTS) |
| Рубль (ГО), в т.ч. МосБирж(FORTS) |               |     |                 |        |                |                       |   | 4 663,63  |        |                |                       |   | 4 637,86  | МосБирж(FORTS) |
| MTSI-9.18                         | Фьючерс       |     |                 | -1     | 25 607,000000  |                       |   |   | -1     | 25 489,000000  |                       |   |   | МосБирж(FORTS) |
| Итого:                            |               |     |                 |        |                |                       |   | 45 464,06   |        |                |                       |   | 45 582,06   |                |

| Обязательства клиента           |                    | на начало периода |         | на конец периода |         |
|---------------------------------|--------------------|-------------------|---------|------------------|---------|
|                                 | Организатор торгов |                   | Сумма   |                  | Сумма   |
| ПО (Рубль)                      | МосБирж(FORTS)     |                   | -121,74 |                  | -139,13 |
| По займам "Овернайт ЦБ" (Рубль) | MMB5               |                   | 0,05    |                  | 0,17    |
| Итого (Рубль):                  |                    |                   | -121,69 |                  | -138,96 |

4. Движение Ценных бумаг

| ЦБ           | Дата     | Остаток на начало дня / начало операции | Приход | Расход | Остаток на конец дня / конец операции | Место хранения        | Примечание                     |
|--------------|----------|---|--------|--------|---------------------------------------|-----------------------|--------------------------------|
| MTSS         | 10.08.18 |   | 200    |        | 200                                   | Торговый раздел (НРД) | 201808095MTSS-0/01-1647        |
| MTSS         | 10.08.18 | 200                                     |        | 200    |                                       | Торговый раздел (НРД) | 201808105MTSS-0/01-1631        |
| MTSS         | 10.08.18 |   | 200    |        | 200                                   | Торговый раздел (НРД) | 201808105MTSS-0/01d-1931       |
| SU26205RMFS3 | 10.08.18 | 160                                     |        | 160    |                                       | Торговый раздел (НРД) | 201808105SU26205RMFS3-0/01-65  |
| SU26205RMFS3 | 10.08.18 |   | 160    | 160    |                                       | Торговый раздел (НРД) | 201808105SU26205RMFS3-0/01d-66 |

|              |          |     |     |     |                       |                                |
|--------------|----------|-----|-----|-----|-----------------------|--------------------------------|
| SU26214RMFS5 | 10.08.18 | 160 |     | 160 | Торговый раздел (НРД) |                                |
| SU26216RMFS0 | 10.08.18 | 10  |     | 10  | Торговый раздел (НРД) |                                |
| SU26217RMFS8 | 10.08.18 |     | 160 | 160 | Торговый раздел (НРД) | 201808095SU26217RMFS8-0/01-172 |
| FXMM_RM      | 10.08.18 | 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: 13.08.2018

\_\_\_\_\_/Карасев О.В./

Отчет получен \_\_\_\_\_