Инструкция по чтению отчета на биржевом срочном рынке (FORTS / СПбМТСБ)

Изменения

Дата изменения	Описание изменения
20.08.2009	1. В разделе **Открытые позиции** переименован столбец "Позиция, шт." на "Позиция, лоты/шт." 2. Изменено название раздела **Сделки в ТС** на **Операции в ТС**. 3. В блоке **Операции в торговой системе: Фьючерсы и Опционы** раздела **Операции в ТС** переименованы столбцы "Куплено, шт." и "Продано, шт." на "Куплено, лоты" и "Продано, лоты." 3. В разделе **Операции в ТС** добавлены новые блоки: - **Операции в торговой системе: RTS Standard**; - **Операции в торговой системе (адресные сделки): RTS Standard**; 4. В разделе **Исполнение опционов** изменено описание столбцов "Куплено" и "Продано"
24.05.2012	В блоке **Операции в торговой системе**: **Фьючерсы и Опционы** добавлены поля: «Цена/премия, руб», «Котировка», «Вар.маржа», «Комиссия биржи, руб», «Комиссия брокера, руб».
19.10.2012	Блок **Операции в торговой системе: Фьючерсы и Опционы** переименован в **Операции в торговой системе.** В указанном блоке изменено значение поля **«**Вид».
27.03.2013	Блок **Операции в торговой системе (адресные сделки и РЕПО): РТС Стандарт** добавлено поле «№ сделки РЕПО». В раздел **Задолженности / Обязательства клиента перед Брокером** добавлены новые поля «Валюта» и «Код валюты».
06.09.2013	Внесены уточнения о зависимости статуса отчета, сформированного в Личном кабинете, от времени формирования отчета.
20.09.2013	Наименование раздела **Задолженности клиента** переименовано в **Задолженности / Обязательства клиента перед Брокером**
08.09.2013	Внесены правки в наименование торговых систем.
27.03.2014	Внесены изменения в наименование отчета и структуру заголовка.
12.11.2014	В разделе **Исполнение опционов** - название поля «Код» переименовано в «Код контракта»; - добавлены поля «Организатор торговли» и «Операция»; - внесены уточнения в описание полей «Куплено», «Продано» и «Цена».
09.06.2015	В раздел **Сводная информация по счету клиента** добавлено поле «Из них рублей»**.** Внесены изменения в наименования полей «Входящий остаток» и «Исходящий остаток»**.**
05.04.2016	Переименован раздел **Операции в торговой системе**. Новое название **Срочные сделки с производными финансовыми операциями**.
26.05.2016	Изменен раздел **Гарантийные обязательства**
08.02.2017	Добавлен раздел **Исполнение**
07.04.2017	Наименование раздела **Движение денежных средств** изменено на **Прочие зачисления/ списания денежных средств.** Изменена структура блока.
07.08.2017	Изменена форма раздела **Сводная информация по счету клиента**; Добавлен раздел **Требования к обеспечению.** Раздел **Гарантийные обязательства** исключен.
03.10.2017	Добавлены разделы: «**Заключенные в отчетном периоде внебиржевые сделки конвертации**», «**Завершенные в отчетном периоде внебиржевые сделки конвертации**», «**Незавершенные в отчетном периоде внебиржевые сделки конвертации прошлых периодов**».
08.06.2018	Добавлено поле «Комментарий» в разделы: «**Заключенные в отчетном периоде внебиржевые сделки конвертации**», «**Завершенные в отчетном периоде внебиржевые сделки конвертации**», «**Незавершенные в**

	отчетном периоде внебиржевые сделки конвертации прошлых периодов».
25.12.2018	В раздел «**Задолженности / Обязательства Клиента перед Брокером**» добавлено поле «Из них заблокировано».
24.10.2023	В разделе **Исполнение** исключено поле "Последняя цена" Добавлено поле «Дата» в разделы: **Исполнение** и **Исполнение опционов**

Содержание

Содержание 2
Форматы отчетов 2
1. Сводная информация по счету клиента 3
2. Требования к обеспечению 4
3. Задолженности / Обязательства клиента перед Брокером 5
4. Открытые позиции 5
5. Срочные сделки с производными финансовыми инструментами 6
5.1. Срочные сделки с производными финансовыми инструментами 6
5.2. Срочные сделки с производными финансовыми инструментами: РТС Стандарт (по операциям до 27.03.2014) 6
5.3. Срочные сделки с производными финансовыми инструментами (адресные сделки и РЕПО): РТС Стандарт (по операциям до 27.03.2014) 7
6. Исполнение 7
7. Исполнение опционов 8
8. Прочие зачисления/ списания денежных средств 8
9. Заключенные в отчетном периоде внебиржевые сделки конвертации 8
10. Завершенные в отчетном периоде внебиржевые сделки конвертации 9
11. Незавершенные в отчетном периоде внебиржевые сделки конвертации прошлых периодов 9
Под отчетом 10

В отчетах отображается информация о сделках, совершенных Вами в течение отчетного периода на Срочных рынках ПАО «Московская биржа» (FORTS), Срочном рынке СПбМТСБ, ПАО «Санкт-Петербургская биржа», АО «Мосэнергобиржа», РТС СТАНДАРТ (до 27.03.2014), и информация о состоянии Активов в разрезе Ваших Лицевых счетов.
Ежедневный отчет, сформированный в Личном кабинете после 14:00 рабочего дня, следующего за отчетной датой, является официальным Ежедневным отчетом Брокера.

Ежедневный отчет, сформированный в Личном кабинете до 14:00 рабочего дня следующего за отчетной датой, а также отчеты, сформированные за период больше одного дня и по группе из нескольких счетов, всегда являются информационно-справочными.

Форматы отчетов

Отчет можно сформировать в формате Excel, нажав соответствующую кнопку Excel.

Для того чтобы получить отчет (за конкретную дату или период) зайдите в Личный кабинет, выберите раздел для формирования отчета.

В заголовке отчета указаны:

- Дата или период, за который сформирован отчет;
- Информация о клиенте:
  - **Клиент** — номер инвестиционного счета, Ф.И.О. Клиента или наименование юридического лица Клиента;
  - **Договор на брокерское обслуживание** — номер и дата договора на брокерское обслуживание;
  - **Портфель** — Срочный рынок FORTS (СР FORTS)/ Срочный рынок СПбМТСБ (СР СПбМТСБ);
  - **Лицевой счет** — номер лицевого счета для группировки и хранения данных о количестве Имущества и Обязательств Клиента по Инвестиционному счету (или субсчету Инвестиционного счета Клиента при наличии) и Портфелю Клиента.

1. Сводная информация по счету клиента

Блок содержит сводную информацию по счету клиента в разрезе следующих столбцов:

- Основание – входящий и исходящий остаток Имущества Клиента и виды операций, которые осуществлялись в отчетном периоде;
- Сумма – сумма ДС по указанному Основанию;
- Валюта – код валюты;
- Оценка остатка по курсу ЦБ, руб. – оценка указывается для оснований Входящий остаток, Исходящий остаток, выраженных в иностранной валюте;
- Оценка остатка по методологии биржи, руб. – оценка указывается для оснований Входящий остаток, Исходящий остаток, выраженных в иностранной валюте.

Входящий остаток (факт) — сумма денежных средств в соответствующей Валюте, которая была на счете Клиента на начало торгового дня. Входящий остаток равен исходящему остатку за предыдущий торговый день. Сумма входящего остатка в иностранной валюте дополнительно отображается в рублевой оценке по курсу Банка России и по курсу, рассчитанному по методологии биржи.

Вариационная маржа/Сумма выплаты — сумма вариационной маржи/ сумма выплаты, уплаченная / полученная по всем контрактам, определяется по каждой позиции по фьючерсному контракту или опционному контракту в соответствии со Спецификацией фьючерсного контракта или Спецификацией опционного контракта.

Гарантийный перевод — сумма Гарантийных переводов по сделкам.

(н-р, до 27.03.2014 по всем сделкам, совершенным в режиме T+N БР РТС (далее: сделки T+N) Гарантийный перевод определяется по каждой сделке T+N:

1. По сделке, по которой расчет Гарантийного перевода ранее не осуществлялся, Гарантийный перевод определяется как денежное выражение разницы между ценой заключения сделки и расчетной ценой текущего клирингового сеанса.

2. По Контракту, по которому расчет Гарантийного перевода осуществлялся ранее, Гарантийный перевод определяется как денежное выражение разницы между расчетной ценой предыдущего и текущего клирингового сеанса).

Движение средств – сальдированная сумма неторговых операций.

Исходящий остаток (факт) — сумма денежных средств (ДС) в соответствующей Валюте, которая осталась на счете Клиента после окончания торгового дня (учитывая комиссии брокера, вариационную маржу, гарантийный перевод, ввод/ вывод ДС и премию, полученную/ уплаченную по опционам). Сумма исходящего остатка в иностранной валюте дополнительно отображается в рублевой оценке по курсу Банка России и по курсу, рассчитанному по методологии биржи.

Исходящий остаток с учетом опционов (справочно) — сумма ДС на счете Клиента в рублевой оценке, если бы опционные позиции были бы закрыты по котировкам на конец торгового дня. Рассчитывается как сумма исходящего денежного остатка на счете плюс стоимость купленных опционов минус стоимость проданных опционов.

Кроме вышеперечисленных, в данном разделе отображаются сводные данные по различным типам операций, которые осуществлялись в течение отчетного периода, например, Комиссия Брокера/ Доп. комиссия Брокера «Сборы ТС» за заключение сделок, комиссия биржи и прочее.

2. Требования к обеспечению

Блок содержит информацию о требованиях к обеспечению в разрезе активов, общую оценку активов, оценку требуемого обеспечения и информацию о свободных либо недостаточных активах на счете.

Блок состоит из следующих столбцов:

- Активы, принимаемые в обеспечение – наименование активов, принятых Брокером для обеспечения исполнения сделок на срочном рынке, совершаемых по Портфелю;
- Количество – количество активов на лицевом счете на конец Периода отчета;
- Курс/цена – отображает курс/ цену актива по методологии биржи, для рублей указывается курс единица;
- Оценка обеспечения в руб. – количество актива по курсу / цене, указанной в поле «Курс/цена»; Итого - рублевая оценка активов на лицевом счете клиента; Требуется - рублевая оценка активов, требуемых для поддержания открытых позиций на счете Клиента, обязательств клиента; Свободно/недостаточно - рублевая оценка активов, свободных от обязательств/ недостаточных под обязательства. Значение участвует в расчете комиссии за Услугу предоставления информации по риск-поддержке открытой позиции. Оценка активов, размера свободного и требуемого обеспечения отражается на момент окончания торгового периода даты окончания отчетного периода;

3. Задолженности / Обязательства клиента перед Брокером

- **Тип задолженности** — наименование типа задолженности Клиента;
- **Счет Клиента** — номер счета Клиента;
- **Дата** — дата образования задолженности;
- **Начислено валюте** — сумма начисленной комиссии в валюте начисления на дату формирования отчета;
- **Из них заблокировано** — сумма задолженности, заблокированной для уплаты годового налога;
- **Остаток в валюте** — сумма оставшейся задолженности Клиента в валюте начисления;
- **Валюта** — код валюты начисления;
- **Остаток по курсу ЦБ, руб**. — сумма оставшейся задолженности Клиента в рублях, по курсу ЦБ РФ для валютной задолженности;
- **Основание** — основание образования задолженности у Клиента.

Информация в отчете разбита на блоки по видам задолженностей (например, задолженности по комиссиям за сервисы, задолженности по минимальной ежемесячной комиссии и проч.).

В нижней строке каждого блока отображается суммарная оценка задолженности Клиента по этому блоку начисленная (сумма столбца **Начислено**) и оставшаяся (сумма столбца **Остаток**).

В нижней строке всего блока указывается суммарная задолженность Клиента, начисленная и оставшаяся по всем видам задолженностей.

4. Открытые позиции

- **Контракт** — тип контракта;
- **Код контракта** — код контракта;
- **Цена исп-я (опционы)** — цена исполнения опциона;
- **Открыта** — дата открытия позиции;
- **Цена** — цена покупки или продажи контракта в пунктах для фьючерсов и опционов; цена покупки или продажи в рублях за одну ЦБ для контрактов РТС Стандарт;
- **Позиция, лоты/шт.** — количество купленных или проданных контрактов по одной и той же цене в лотах (фьючерсы и опционы) или в шт. (РТС Стандарт);
- **Котировка** — котировка;
- **Текущая стоимость** — произведение позиции на котировку;
- **Организатор торговли** — сокращенное наименование организатора торговли, на площадке которого был(а) куплен(а)/продан(а) контракт, ценная бумага (если в портфеле есть одинаковые ценные бумаги (ЦБ), купленные на разных площадках, по каждой из них в отчете будет несколько строк).

Строки сгруппированы по типам контрактов. Для каждой группы контрактов указывается котировка (расчетная цена по окончании торгов), количество купленных или проданных контрактов данного типа и средневзвешенная цена покупки или продажи. Текущие стоимости опционов суммируются, и полученная сумма отображается внизу таблицы. Суммарная стоимость купленных и

проданных опционов используется для расчета планируемого исходящего остатка на счете с учетом опционов.

5. Срочные сделки с производными финансовыми инструментами

В данном разделе отчета в табличном виде представлены все сделки с фьючерсами, опционами и контрактами РТС Стандарт, которые были отнесены на счет Клиента за отчетную дату. Сделки сгруппированы по типу контрактов. Внутри группы сделки расположены в хронологическом порядке. Внимательно проверьте соответствие представленных в отчете данных вашим записям и в случае возникновения разночтений немедленно сообщите об этом брокеру.

Операции разбиты на 3 блока:

5.1. Срочные сделки с производными финансовыми инструментами

- **Контракт** — тип контракта;
- **Код контракта** — код контракта;
- **№ заявки** — номер заявки на покупку или продажу контракта в торговой системе;
- **Идентификатор/ Номер сделки** — номер сделки в торговой системе;
- **Дата** — дата заключения сделки в торговой системе;
- **Время** — время заключения сделки в торговой системе;
- **Вид** — тип контракта («PUT» — опцион PUT, «CALL» — опцион CALL, «FUT» — фьючерс / форвард / своп);
- **Куплено, лоты** — количество купленных контрактов в лотах;
- **Продано, лоты** — количество проданных контрактов в лотах;
- **Цена / премия, пункты** — цена покупки или продажи контракта в пунктах;
- **Цена/премия, руб** — цена сделки в рублях;
- **Котировка** — котировка контракта на дату сделки;
- **Вар. маржа** — вариационная маржа по сделке;
- **Комиссия биржи, руб** — комиссия биржи по сделке в рублях;
- **Комиссия брокера, руб** — комиссия брокера по сделке в рублях;
- **Организатор торговли** — сокращенное наименование организатора торговли, на площадке которого был(а) куплен(а) / продан(а) контракт, ценная бумага (если в портфеле есть одинаковые ценные бумаги (ЦБ), купленные на разных площадках, по каждой из них в отчете будет несколько строк);
- **Комментарий** — комментарий.

5.2. Срочные сделки с производными финансовыми инструментами: РТС Стандарт (по операциям до 27.03.2014)

- **Ценная бумага** — краткое наименование (выпуска) ЦБ;
- **Гос. рег. номер** — государственный регистрационный номер выпуска ЦБ;
- **Код контракта** — код контракта РТС Стандарт;
- **№ заявки** — номер заявки на покупку или продажу ЦБ в торговой системе;
- **Идентификатор/ Номер сделки** — номер сделки в торговой системе;
- **Торговая дата** — дата заключения сделки в торговой системе;
- **Календарная дата** — фактическая дата заключения сделки. Отличается от Торговой даты в вечернюю сессию;
- **Время** — время заключения сделки в торговой системе;
- **Дата исполнения обязательств** — дата исполнения обязательств;

- **Куплено, шт.** — количество купленных ЦБ в штуках;
- **Продано, шт**. — количество проданных ЦБ в штуках;
- **Цена, руб** — цена покупки или продажи одной ЦБ в рублях;
- **Стоимость сделки, руб** — произведение цены на количество ЦБ, выраженное в рублях;
- **Комиссия брокера, руб** — вознаграждение брокера в рублях;
- **Комиссия биржи, руб** — комиссия биржи в рублях;
- **Организатор торговли** — сокращенное наименование организатора торговли, на площадке которого была куплена/ продана данная ЦБ (если в портфеле есть одинаковые ЦБ, купленные на разных площадках, по каждой из них в отчете будет несколько строк).

5.3. Срочные сделки с производными финансовыми инструментами (адресные сделки и РЕПО): РТС Стандарт (по операциям до 27.03.2014)

- **Ценная бумага** — краткое наименование (выпуска) ЦБ;
- **Гос. рег. номер** — государственный регистрационный номер выпуска ЦБ;
- **Код контракта** — код контракта РТС Стандарт;
- **№ заявки** — номер заявки на покупку или продажу ценных бумаг в торговой системе;
- **№ сделки РЕПО** — номер сделки РЕПО в торговой системе. Заполняется только для сделок РЕПО. Для обеих частей сделки РЕПО указывается один номер сделки РЕПО;
- **Идентификатор/ Номер сделки** — номер сделки в торговой системе. Для сделок РЕПО указывается номер первой или второй частей сделки РЕПО в торговой системе;
- **Торговая дата** — дата заключения сделки в торговой системе;
- **Календарная дата** — фактическая дата заключения сделки. Отличается от Торговой даты в вечернюю сессию;
- **Время** — время заключения сделки в торговой системе;
- **Дата исполнения обязательств** — дата исполнения обязательств;
- **Куплено, шт.** — количество купленных ЦБ в штуках;
- **Продано, шт.** — количество проданных ЦБ в штуках;
- **Цена, руб** — цена покупки или продажи одной ЦБ в рублях;
- **Стоимость сделки, руб** — произведение цены на количество ЦБ, выраженное в рублях;
- **Комиссия брокера, руб** — вознаграждение брокера в рублях;
- **Комиссия биржи, руб** — комиссия биржи в рублях;
- **Организатор торговли** — сокращенное наименование организатора торговли, на площадке которого была куплена/ продана данная бумага (если в портфеле есть одинаковые ЦБ, купленные на разных площадках, по каждой из них в отчете будет несколько строк);
- **Комментарий** — тип сделки: перенос, закрытие брокером позиции РТС Стандарт, прочие адресные сделки РТС Стандарт.

6. Исполнение

- **Дата** — дата операции исполнения контракта;
- **Контракт** — краткий код контракта;
- **Код контракта** — полный код контракта;

- **Куплено, шт** — количество исполненных проданных фьючерсных контрактов;
- **Продано, шт** — количество исполненных купленных фьючерсных контрактов;
- **Цена** - цена закрытия;
- **Организатор торговли** — сокращенное наименование организатора торговли, на площадке которого совершена операция исполнения контракта.

7. Исполнение опционов

- **Дата** — дата операции исполнения / истечения контракта;
- **Контракт** — краткий код контракта;
- **Код контракта** — полный код контракта;
- **Куплено** — для фьючерса количество открытых фьючерсных контрактов на покупку в результате исполнения опционных контрактов по цене исполнения; для опциона количество проданных опционных контрактов, которые исполнились по инициативе покупателя / срок обращения которых истек;
- **Продано** — для фьючерса количество открытых фьючерсных контрактов на продажу в результате исполнения опционных контрактов по цене исполнения; для опциона количество купленных опционных контрактов, исполненных по инициативе покупателя / срок обращения которых, истек;
- **Цена** — цена исполнения. Для операции истечения опциона — «0»;
- **Организатор торговли** — сокращенное наименование организатора торговли, на площадке которого совершена операция исполнения контракта;
- **Операция —** исполнение / истечение опциона.

8. Прочие зачисления/ списания денежных средств

- **Дата** — дата зачисления/ списания ДС;
- **Валюта** — валюта операции с ДС**;**
- **Сумма** — сумма зачисленных/ списанных ДС в Валюте;
- **Описание** — расшифровка типа операции.

9. Заключенные в отчетном периоде внебиржевые сделки конвертации

- **Номер сделки;**
- **Номер поручения/заявки** — номер поручения Клиента в системе регистрации поручений Брокера или номер заявки в системе QUIK на сделку Конвертации ДС. По сделкам конвертации, заключенным Брокером на основании условных поручений, установленных Договором с Клиентом, номер поручения / заявки не проставляется**;**
- **Дата заключения сделки;**
- **Время заключения сделки;**
- **Тип сделки** — конвертация;
- **Направление сделки** — «S», если продажа Актива 1 или «B», если покупка Актива 1;
- **Актив 1;**

- **Сумма Актива 1;**
- **Курс сделки;**
- **Актив 2;**
- **Сумма актива 2;**
- **Дата расчетов (план)** — плановая дата расчетов по сделке**;**
- **Дата расчетов (факт)** — фактическая дата расчетов по сделке**;**
- **Комиссия Брокера;**
- **Валюта Комиссии;**
- **Контрагент;**
- **Комментарий** — дополнительная информация о сделке (н-р, для сделок закрытия позиции указывается комментарий «Закрытие позиции» (Close-out - для русско-английской версии отчета)).

10. Завершенные в отчетном периоде внебиржевые сделки конвертации

- **Номер сделки;**
- **Номер поручения/заявки** — номер поручения Клиента в системе регистрации поручений Брокера или номер заявки в системе QUIK на сделку Конвертации ДС. По сделкам конвертации, заключенным Брокером на основании условных поручений, установленных Договором с Клиентом, номер поручения / заявки не проставляется**;**
- **Дата заключения сделки;**
- **Время заключения сделки;**
- **Тип сделки** — конвертация**;**
- **Направление сделки** — «S», если продажа Актива 1 или «B», если покупка Актива 1;
- **Актив 1;**
- **Сумма Актива 1;**
- **Курс сделки;**
- **Актив 2;**
- **Сумма актива 2;**
- **Дата расчетов (план)** — плановая дата расчетов по сделке**;**
- **Дата расчетов (факт)** — фактическая дата расчетов по сделке**;**
- **Комиссия Брокера;**
- **Валюта Комиссии;**
- **Контрагент;**
- **Комментарий** — дополнительная информация о сделке (н-р, для сделок закрытия позиции указывается комментарий «Закрытие позиции» (Close-out - для русско-английской версии отчета))**.**

11. Незавершенные в отчетном периоде внебиржевые сделки конвертации прошлых периодов

- **Номер сделки;**
- **Номер поручения/заявки** — номер поручения Клиента в системе регистрации поручений Брокера или номер заявки в системе QUIK на

сделку Конвертации ДС. По сделкам конвертации, заключенным Брокером на основании условных поручений, установленных Договором с Клиентом, номер поручения / заявки не проставляется**;**

- **Дата заключения сделки;**
- **Время заключения сделки;**
- **Тип сделки** — конвертация**;**
- **Направление сделки** — «S», если продажа Актива 1 или «B», если покупка Актива 1**;**
- **Актив 1;**
- **Сумма Актива 1;**
- **Курс сделки;**
- **Актив 2;**
- **Сумма актива 2;**
- **Дата расчетов (план)** — плановая дата расчетов по сделке**;**
- **Дата расчетов (факт)** — фактическая дата расчетов по сделке**;**
- **Комиссия Брокера;**
- **Валюта Комиссии;**
- **Контрагент**
- **Комментарий** — дополнительная информация о сделке (н-р, для сделок закрытия позиции указывается комментарий «Закрытие позиции» (Close-out - для русско-английской версии отчета))**.**

Под отчетом

В нижней части отчета указаны ФИО и должность сотрудника АО «Открытие Брокер», ответственного за составление отчета.