DIR-25680-1246240

Инструкция по чтению отчета по Единому брокерскому счету

Изменения

Дата изменения	Описание изменения
26.05.2016	Внесены изменения в раздел Требования к ликвидности обеспечения.
20.07.2016	Добавлен раздел Операции блокировки ЦБ.
13.12.2016	Добавлен раздел Поручения на конвертацию.
01.03.2017	Раздел «Детализация сумм, заблокированных под обязательства по возврату доходов» переименован в «Детализация сумм обязательств Клиента по возврату доходов».
27.07.2017	В раздел «Справочник финансовых инструментов» добавлено поле «НКД на одну ЦБ в рублях».
02.10.2017	Инструкция доработана в связи с добавлением Валютного рынка в портфель «ЕБС», а также в связи с добавлением в форму отчета разделов для отражения внебиржевых сделок конвертации: «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».
11.07.2018	В разделы «Заключенные в отчетном периоде сделки купли/продажи с ценными бумагами» и «Заключенные в отчетном периоде сделки РЕПО» внесены изменения: ▪ добавлено поле «Валюта комиссии Брокера»; ▪ поле «Комиссия Брокера/Доп. комиссия Брокера «Сборы ТС», руб.» переименовано в «Комиссия Брокера/Доп. комиссия Брокера «Сборы ТС»»; ▪ добавлена информация о строках в конце блоков.
03.10.2018	В разделах «Активы клиента (ценные бумаги и денежные средства) – Предварительное закрытие дня» и «Активы клиента (ценные бумаги и денежные средства) – Итоговое закрытие дня» изменено описание поля «Цена последней сделки в валюте цены (% для облигаций)».
19.10.2018	В блоке 12. Заключенные в отчетном периоде биржевые

	конверсионные сделки и блоке 13. Заключенные в отчетном периоде биржевые сделки СВОП переименован показатель из Ком. Брокер / Доп. Ком. Брокера «Сборы в ТС, руб» в Ком. Брокер / Доп. Ком. Брокера «Сборы в ТС»; добавлен показатель Валюта комиссии Брокера; в конец блока добавлены строки, отражающие итоговые суммы брокерской комиссии в разрезе валюты В разделе Сводная информация по единому счету строка «Обязательства по возврату доходов» переименована в «Ограниченные в использовании активы для возврата дохода по сделкам» Раздел «Детализация сумм обязательств Клиента по возврату доходов» переименован в Ограниченные в использовании активы для возврата дохода по сделкам; в этом же разделе строка «Сумма обязательств» переименована в «Сумма»
17.12.2018	В блоке «Сводная информация по единому счету» строка «Ограниченные в использовании активы для возврата дохода по сделкам» переименована в «Обязательства по возврату дохода»; Блок «Ограниченные в использовании активы для возврата дохода по сделкам» переименован в Детализация сумм обязательств Клиента по возврату доходов

Содержание

Заголовок отчета 3

1. Сводная информация по единому счету 4

2. Требования к ликвидности обеспечения 5

3. Задолженности / Обязательства клиента перед Брокером 6

4. Активы клиента (ценные бумаги и денежные средства) - Предварительное закрытие дня 6

5. Активы клиента (ценные бумаги и денежные средства) - Итоговое закрытие дня 8

6. Открытые позиции 10

7. Нетто обязательства и требования по незавершенным сделкам 11

8. Обязательства и требования по сделкам с валютой 11

9. Заключенные в отчетном периоде сделки купли/продажи с ценными бумагами 12

10. Заключенные в отчетном периоде сделки РЕПО 13

11. Заключенные/измененные в отчетном периоде сделки займа ЦБ 14

12. Заключенные в отчетном периоде биржевые конверсионные сделки 14

13. Заключенные в отчетном периоде биржевые сделки СВОП 15

14. Заключенные в отчетном периоде внебиржевые сделки конвертации 16

15. Завершенные в отчетном периоде сделки купли/продажи с ценными бумагами 17

16. Завершенные в отчетном периоде сделки РЕПО 17

17. Расчеты по сделкам займа ЦБ 18

18. Расчеты по конверсионным сделкам 19
19. Завершенные в отчетном периоде внебиржевые сделки конвертации 19
20. Незавершенные сделки с ценными бумагами прошлых периодов 20
21. Незавершенные сделки займа ЦБ заключенные / измененные в прошлых периодах 21
22. Незавершенные в отчетном периоде внебиржевые сделки конвертации прошлых периодов 22
23. Срочные сделки с производными финансовыми инструментами 22
24. Исполнение опционов 23
25. Исполнение 23
26. Прочие зачисления / списания ценных бумаг 24
27. Операции блокировки ЦБ 24
28. Справочник финансовых инструментов 24
29. Детализация сумм обязательств Клиента по возврату доходов 25

В отчете отображается информация о сделках, совершенных Вами в течение отчетного периода на Фондовом рынке ПАО «Московская биржа», на Срочном рынке ПАО «Московская биржа» (FORTS), Валютном рынке ПАО «Московская биржа», внебиржевом рынке и сальдированная информация о состоянии Ваших Активов в составе Единого счета.

Информация о сделках и состоянии Ваших Активов, за период, Дата окончания которого раньше даты подключения услуги «Единый брокерский счет», предоставляется в трех отдельных отчетах:

- Отчет по Фондовому рынку Московской биржи (ФР МБ);
- Отчет по Биржевому срочному рынку (СР FORTS);
- Отчет по Валютному рынку Московской биржи (ВР МБ).

В случае если услуга «Единый брокерский счет» была подключена раньше 10.04.2017 г., информация о сделках и состоянии Ваших Активов, за период, Дата окончания которого раньше даты подключения Валютного рынка Московской биржи к услуге «Единый брокерский счет» (10.04.2017 г.), предоставляется в двух отдельных отчетах:

- Отчет по Единому брокерскому счету (ЕБС);
- Отчет по Валютному рынку Московской биржи (ВР МБ).

Отчет на сайте формируется в формате XML — современном формате, удобном для загрузки и автоматической обработки.

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

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 так же отчеты, сформированные за период больше одного дня и по группе из нескольких счетов, всегда являются информационно-справочными.

Заголовок отчета

- Дата или период, за который сформирован отчет (далее Период отчета);

- Информация о Клиенте:

  - **Клиент** — номер инвестиционного счета, ФИО Клиента или наименование юридического лица;

  - **Договор на брокерское обслуживание (или Договор на ведение индивидуального инвестиционного счета)** — номер и дата договора;

  - **Портфель** — Единый брокерский счет;

  - **Лицевой счет** — номер лицевого счета для группировки и хранения данных о количестве Имущества и Обязательств Клиента по Инвестиционному счету (или, при наличии, по субсчету Инвестиционного счета Клиента) и Портфелю Клиента.

1. Сводная информация по единому счету

- **Основание:**

  - **Входящий остаток (факт)** — сумма денежных средств (далее ДС) в разрезе валюты на лицевом счете на начало Периода отчета. Входящий остаток (факт) равен Исходящему остатку (факт) на дату, предшествующую дате начала Периода отчета;

  - **Исходящий остаток (факт)** — сумма ДС в разрезе валюты на лицевом счете Клиента с учетом всех операций, проведенных не позднее, чем дата окончания Периода отчета;

  - **Обязательства по возврату дохода –** подробнее см. в п. 29. Детализация сумм обязательств Клиента по возврату доходов;

  - **Оценка активов по курсу ЦБ (факт)** — сумма Исходящего остатка (факт) и оценок остатков ценных бумаг на конец торгового дня (факт) по цене последней сделки в рублях по курсу ЦБ на дату окончания Периода отчета;

  - **Оценка активов по курсу ЦБ (факт+план) (с учетом нерассчитанных сделок по ценным бумагам)** — сумма Оценки активов (Позиция факт + план) в рублях по курсу ЦБ на дату окончания Периода отчета, вычисляемой как сумма ДС, которые поступят или будут уплачены в результате расчетов по сделкам позднее, чем дата окончания Периода отчета, и оценки ценных бумаг, которые будут получены или поставлены в результате расчетов по сделкам позднее, чем дата окончания Периода отчета;

  - **Оценка активов, по Центральному курсу (факт) (Предварительное закрытие дня)** — сумма Исходящего остатка (факт) и оценок остатков ценных бумаг на конец торгового дня (факт) по цене последней сделки в рублях по Центральному курсу Биржи на дату окончания Периода отчета в результате проведения Предварительного закрытия дня;

  - **Оценка активов, по Центральному курсу (факт+план) (с учётом нерассчитанных сделок по ценным бумагам) (Предварительное закрытие дня)** — сумма Оценки активов (Позиция факт+план) в рублях по Центральному курсу Биржи на дату окончания Периода отчета, вычисляемой как сумма ДС, которые поступят или будут уплачены в результате расчетов по сделкам позднее, чем дата окончания Периода отчета, и оценки ценных бумаг, которые будут получены или поставлены в результате расчетов по сделкам позднее, чем дата окончания Периода отчета в результате проведения Предварительного закрытия дня**;**

  - **Оценка активов, по Центральному курсу (факт) (Итоговое закрытие дня)** — сумма Исходящего остатка (факт) и оценок остатков ценных бумаг на конец торгового дня (факт) по цене последней сделки в рублях по Центральному курсу Биржи на дату окончания Периода отчета;

  - **Оценка активов, по Центральному курсу (факт+план) (с учётом нерассчитанных сделок по ценным бумагам) (Итоговое закрытие дня)** — сумма Оценки активов (Позиция факт+план) в рублях по Центральному курсу Биржи на дату окончания Периода отчета, вычисляемой как сумма ДС, которые поступят или будут

уплачены в результате расчетов по сделкам позднее, чем дата окончания Периода отчета, и оценки ценных бумаг, которые будут получены или поставлены в результате расчетов по сделкам позднее, чем дата окончания Периода.

- **Сумма** — сумма ДС по указанному **Основанию** (см. выше);
- **Валюта** — код валюты;
- **Оценка остатка по курсу ЦБ, руб. —** сумма рублевой оценки остатка ДС в иностранной валюте. Для входящего и исходящего остатка (факт) заполняется по курсу ЦБ на дату окончания Периода отчета.

Кроме вышеперечисленных, в данном разделе отображаются сводные данные по различным типам операций, которые осуществлялись в отчетный период, например, Сальдо расчетов, НКД, Вариационная маржа, Комиссия Брокера/ Доп. комиссия Брокера «Сборы ТС» за заключение сделок, Биржевой сбор, Движение средств, проч.

2. Требования к ликвидности обеспечения

- **Активы, принимаемые в обеспечение** – список активов, в том числе, рублей и валюты, принятых Брокером для обеспечения исполнения сделок на фондовом, срочном и валютном рынках, совершаемых по Портфелю «Единый брокерский счет»;
- **Количество:**
  - **Остаток (факт)** – фактическое количество активов на лицевом счете, принимаемых в обеспечение на конец Периода отчета в результате проведения Предварительного закрытия дня;
  - **Позиция (факт + план)** – количество активов на лицевом счете, принимаемых в обеспечение с учетом плановых позиций на конец Периода отчета в результате проведения Предварительного закрытия дня;
- **Цена/курс ЦК** – цена последней сделки на дату окончания Периода отчета в рублях/ Центральный курс Биржи на дату окончания Периода отчета в результате проведения Предварительного закрытия дня;
- **Коэффициент высоколиквидности** – признак высоколиквидного актива:
  - 1 – актив, являющийся высоколиквидным. При реализации актива не происходит потери рыночной стоимости;
  - 0 – актив, не являющийся высоколиквидным. При реализации актива возможна потеря рыночной стоимости;
- **Оценка обеспечения в руб.** – количество актива по столбцу «Позиция (факт + план) по Центральному курсу Биржи или цене, указанной в поле «Цена/курс ЦК»;
- **Оценка высоколиквидного обеспечения в руб.** – количество актива с признаком «Коэффициент высоколиквидности» равным 1 по столбцу «Остаток (факт) по Центральному курсу Биржи или цене, указанной в поле «Цена/курс ЦК».
  - **Итого** - рублевая оценка активов на Едином 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 по столбцу «Оценка обеспечения в руб.» участвует в расчете комиссии за Услугу предоставления информации по риск-поддержке открытой позиции. Значение по столбцу «Оценка высоколиквидного обеспечения в руб.» участвует в расчете комиссии за Услугу предоставления информации по риск-поддержке достаточности ликвидного обеспечения.

Оценка активов, размера свободного и требуемого обеспечения отражается на момент проведения Предварительного закрытия дня дата окончания отчетного периода.

3. Задолженности / Обязательства клиента перед Брокером

- **Вид задолженности**;
- **Счет Клиента** — номер счета Клиента в системе внутреннего учета АО «Открытие Брокер»;
- **Дата** — дата, когда образовалась задолженность;
- **Начислено в валюте** — сумма задолженности Клиента в валюте начисления;
- **Остаток в валюте** — сумма оставшейся задолженности Клиента в валюте начисления на дату окончания Периода отчета;
- **Валюта** — код валюты начисления;
- **Остаток по курсу ЦБ, руб.** — сумма оставшейся задолженности Клиента в рублях на дату окончания Периода отчета (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 оставшейся задолженности Клиента по этой группе (сумма столбца **Остаток по курсу ЦБ**).

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

4. Активы клиента (ценные бумаги и денежные средства) - Предварительное закрытие дня

4.1 Ценные бумаги

- **Инструмент;**
- **Гос. рег. номер;**
- **Активы на конец периода**:
  - **Остаток (факт)** — фактическое количество ЦБ в шт. на лицевом счете на конец Периода отчета в результате проведения Предварительного закрытия дня;
  - **Позиция (факт+план)** — сумма Остатка (факт) и ЦБ в шт., которые будут получены или поставлены в результате расчетов по сделкам, дата заключения которых меньше или равна дате окончания Периода отчета, а дата исполнения больше даты окончания Периода отчета в результате проведения Предварительного закрытия дня;
- **Валюта цены (номинала для облигаций);**
- **Цена последней сделки в валюте цены (% для облигаций)** — цена последней сделки купли-продажи соответствующей ценной бумаги, зафиксированной на Фондовом рынке МБ в режиме основных торгов. В случае, если на Фондовом рынке МБ в режиме основных торгов не было зафиксировано ни одной сделки купли-продажи соответствующей ценной бумаги в течение текущего торгового дня, цена одной ценной бумаги рассчитывается исходя из цены закрытия предыдущего торгового дня, вычисляемой Организатором торгов в соответствии с нормативно-правовыми актами РФ

за последние 90 календарных дней. Если с соответствующей ценной бумагой были зафиксированы сделки на Фондовом рынке МБ в режиме первичного размещения, и не было зафиксировано сделок купли-продажи в основном режиме торгов, то цена одной ценной бумаги – цена первичного размещения;

- **Центральный курс к руб. на конец периода —** центральный курс валюты по отношению к рублю на дату окончания Периода отчета, установленный ПАО «Московская биржа»;

- **НКД на конец периода, руб. (по Центральному курсу)** — общая сумма накопленного купонного дохода на Остаток (факт) на конец Периода отчета в рублях по Центральному курсу на конец Периода отчета (для облигаций);

- **Оценка Остатка (факт) по цене последней сделки, руб. (по Центральному курсу)**[1] — оценка Остатка (факт), включая НКД (для облигаций), на конец Периода отчета в рублях по Центральному курсу на конец Периода отчета;

- **Оценка Позиции (факт+план) по цене последней сделки, руб. (по Центральному курсу)**[2] — оценка Позиции (факт+план), включая НКД (для облигаций), на конец Периода отчета в рублях по Центральному курсу на конец Периода отчета;

Информация в отчете разбита на блоки по видам ЦБ (акции, облигации, РДР, Паи ПИФ и т. п.).

В итоговой строке отображается суммарная рублевая оценка Остатка (факт) и суммарная рублевая оценка Позиции (факт+план) на конец Периода отчета в результате проведения Предварительного закрытия дня.

4.2 Денежные средства

- **Денежные средства;**
- **Код валюты;**
- **Активы на конец периода:**

  - **Остаток (факт)** — фактическое количество ДС на лицевом счете на дату окончания Периода отчета в результате проведения Предварительного закрытия дня;

  - **Позиция (факт+план)** — сумма Остатка (факт) и ДС, которые поступят или будут уплачены в результате расчетов по сделкам, дата заключения которых меньше или равна дате окончания Периода отчета, а дата исполнения больше даты окончания Периода отчета в результате проведения Предварительного закрытия дня;

- **Центральный курс к руб. на конец периода** — центральный курс валюты по отношению к рублю на дату окончания Периода отчета, установленный ПАО «Московская биржа»;

- **Оценка Остатка (факт) по Центральному курсу, руб.** — оценка Остатка (факт) на конец периода в рублях по Центральному курсу на конец Периода отчета;

- **Оценка Позиции (факт+план), по Центральному курсу, руб.** — оценка Позиции (факт+план) на дату окончания Периода отчета в рублях по Центральному курсу на конец Периода отчета;

В нижней строке блока отображается суммарная оценка Остатка (факт) и суммарная оценка Позиции (факт+план) на конец периода в рублях в результате проведения Предварительного закрытия дня.

[1] Оценка по дефолтным облигациям с истекшей датой погашения в отчете Брокера не указывается.

5. Активы клиента (ценные бумаги и денежные средства) - Итоговое закрытие дня

5.1 Ценные бумаги

- **Инструмент;**
- **Гос. рег. номер;**
- **Активы на начало периода:**
  - **Остаток (факт)** — фактическое количество ценных бумаг (далее – ЦБ) в шт. на лицевом счете на начало Периода отчета;
  - **Позиция (факт+план)** — сумма Остатка (факт) и количества ЦБ в шт., которые будут получены или поставлены в результате расчетов по сделкам, дата заключения которых меньше даты начала Периода отчета, а дата исполнения больше или равна дате начала Периода отчета;
- **Изменение за период:**
  - **Остаток (факт)** — количество ЦБ в шт., на которое изменился Остаток (факт) за Период отчета;
  - **Позиция (факт+план)** — количество ЦБ в шт., на которое изменилась Позиция (факт+план) за Период отчета;
- **Активы на конец периода**:
  - **Остаток (факт)** — фактическое количество ЦБ в шт. на лицевом счете на конец Периода отчета;
  - **Позиция (факт+план)** — сумма Остатка (факт) и ЦБ в шт., которые будут получены или поставлены в результате расчетов по сделкам, дата заключения которых меньше или равна дате окончания Периода отчета, а дата исполнения больше даты окончания Периода отчета;
- **Заблокировано от вывода** — ЦБ в шт., заблокированные от вывода, например, по корпоративным действиям;
- **Валюта цены (номинала для облигаций);**
- **Цена последней сделки в валюте цены (% для облигаций)** — цена последней сделки купли-продажи соответствующей ценной бумаги, зафиксированной на Фондовом рынке МБ в режиме основных торгов. В случае, если на Фондовом рынке МБ в режиме основных торгов не было зафиксировано ни одной сделки купли-продажи соответствующей ценной бумаги в течение текущего торгового дня, цена одной ценной бумаги рассчитывается исходя из цены закрытия предыдущего торгового дня, вычисляемой Организатором торгов в соответствии с нормативно-правовыми актами РФ за последние 90 календарных дней. Если с соответствующей ценной бумагой были зафиксированы сделки на Фондовом рынке МБ в режиме первичного размещения, и не было зафиксировано сделок купли-продажи в основном режиме торгов, то цена одной ценной бумаги – цена первичного размещения;
- **Курс ЦБ к руб. на конец периода —** курс валюты ЦБ РФ по отношению к рублю на дату окончания Периода отчета (см. http://www.cbr.ru/);
- **НКД на конец периода, руб. (по курсу ЦБ)** — общая сумма накопленного купонного дохода на Остаток (факт) на конец Периода отчета (для облигаций) в рублях по курсу ЦБ РФ на конец Периода отчета;

- **Оценка Остатка (факт) по цене последней сделки, руб. (по курсу ЦБ)**[2] — оценка Остатка (факт), включая НКД (для облигаций), на конец Периода отчета в рублях по курсу ЦБ РФ на конец Периода отчета;

- **Оценка Позиции (факт+план) по цене последней сделки, руб. (по курсу ЦБ)**[2] — оценка Позиции (факт+план), включая НКД (для облигаций), на конец Периода отчета в рублях по курсу ЦБ РФ на конец Периода отчета;

- **Центральный курс к руб. на конец периода —** центральный курс валюты по отношению к рублю на дату окончания Периода отчета, установленный ПАО «Московская биржа»;

- **НКД на конец периода, руб. (по Центральному курсу)** — общая сумма накопленного купонного дохода на Остаток (факт) на конец Периода отчета в рублях по Центральному курсу на конец Периода отчета (для облигаций);

- **Оценка Остатка (факт) по цене последней сделки, руб. (по Центральному курсу)**[2] — оценка Остатка (факт), включая НКД (для облигаций), на конец Периода отчета в рублях по Центральному курсу на конец Периода отчета;

- **Оценка Позиции (факт+план) по цене последней сделки, руб. (по Центральному курсу)**[2] — оценка Позиции (факт+план), включая НКД (для облигаций), на конец Периода отчета в рублях по Центральному курсу на конец Периода отчета;

- **Вес позиции в портфеле (по курсу ЦБ), %** — процент от общей оценки портфеля в рублях по курсу ЦБ РФ (доля актива в портфеле);

- **Вес позиции в портфеле (по Центральному курсу), %** — процент от общей оценки портфеля в рублях по Центральному курсу (доля актива в портфеле).

Информация в отчете разбита на блоки по видам ЦБ (акции, облигации, РДР, Паи ПИФ и т. п.).

В итоговой строке отображается суммарная оценка Остатка (факт) и суммарная оценка Позиции (факт+план) на конец Периода отчета в рублях в результате проведения итогового закрытия дня.

5.2 Денежные средства

- **Денежные средства;**
- **Код валюты;**
- **Актив на начало периода:**
  - **Остаток (факт)** — фактическое количество ДС на лицевом счете на начало Периода отчета;
  - **Позиция (факт+план)** — сумма Остатка (факт) и ДС, которые поступят или будут уплачены в результате расчетов по сделкам, дата заключения которых меньше даты начала Периода отчета, а дата исполнения больше или равна дате начала Периода отчета;
- **Изменение за период**:
  - **Остаток (факт)** — количество ДС, на которое изменился Остаток (факт) за Период отчета;
  - **Позиция (факт+план)** — количество ДС, на которое изменилась Позиция (факт+план) за Период отчета;

[2] Оценка по дефолтным облигациям с истекшей датой погашения в отчете Брокера не указывается.

- **Актив на конец периода:**

  - **Остаток (факт)** — фактическое количество ДС на лицевом счете на дату окончания Периода отчета;

  - **Позиция (факт+план)** — сумма Остатка (факт) и ДС, которые поступят или будут уплачены в результате расчетов по сделкам, дата заключения которых меньше или равна дате окончания Периода отчета, а дата исполнения больше даты окончания Периода отчета;

- **Заблокировано от вывода** — ДС, заблокированные от вывода (например, под дивиденды);

- **Курс ЦБ к руб. на конец периода** — курс валюты ЦБ РФ на дату окончания Периода отчета;

- **Оценка Остатка (факт) по курсу ЦБ, руб.** — оценка Остатка (факт) на конец периода в рублях по курсу ЦБ РФ на конец периода;

- **Оценка Позиции (факт+план), по курсу ЦБ, руб.** — оценка Позиции (факт+план) на дату окончания Периода отчета в рублях по курсу ЦБ РФ на конец периода;

- **Центральный курс к руб. на конец периода —** центральный курс валюты по отношению к рублю на дату окончания Периода отчета, установленный ПАО «Московская биржа»;

- **Оценка Остатка (факт) по Центральному курсу, руб.** — оценка Остатка (факт), на конец Периода отчета в рублях по Центральному курсу на конец Периода отчета;

- **Оценка Позиции (факт+план) по Центральному курсу, руб.** — оценка Позиции (факт+план) на конец Периода отчета в рублях по Центральному курсу на конец Периода отчета;

- **Вес позиции в портфеле, %** — процент от общей оценки портфеля в рублях по курсу ЦБ РФ (доля актива в портфеле);

- **Вес позиции в портфеле (по Центральному курсу), %** — процент от общей оценки портфеля в рублях по Центральному курсу (доля актива в портфеле)..

В нижней строке блока отображается суммарная оценка Остатка (факт) и суммарная оценка Позиции (факт+план) на конец периода отчета в рублях в результате проведения итогового закрытия дня.

6. Открытые позиции

В блоке «Открытые позиции» отражаются позиции, открытые по срочным сделкам, совершенным за период отчета на биржевом рынке FORTS.

- **Контракт** — тип контракта;

- **Код контракта** — код контракта;

- **Цена исп-я (опционы)** — цена исполнения опциона;

- **Открыта** — дата открытия позиции;

- **Цена** — цена покупки или продажи контракта, для фьючерсов и опционов указывается в пунктах;

- **Позиция, лоты/шт.** — количество купленных или проданных контрактов по одной и той же цене в лотах (фьючерсы и опционы);

- **Котировка** — котировка;

- **Текущая стоимость** — произведение позиции на котировку;

- **Организатор торговли** — сокращенное наименование организатора торговли, на площадке которого был куплен/продан контракт.

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.

7. Нетто обязательства и требования по незавершенным сделкам

Блок формируется по данным о незавершенных сделках с ценными бумагами.

- **Плановая дата исполнения;**
- **Дата возникновения;**
- **Инструмент** — код валюты или краткое наименование ЦБ;
- **Расчеты по сделкам:**
  - **Обязательства клиента**— количество единиц инструмента, которое будет списано с Лицевого счета в Плановую дату исполнения;
  - **Требования клиента**— количество единиц инструмента, которое поступит на Лицевой счет в Плановую дату исполнения;
- **Возврат ГП / КВ, руб.**
  - **Обязательства клиента по возврату ГП/КВ, руб.** — ДС, которые будут списаны с Лицевого счета в качестве возврата суммы Гарантийных переводов или Компенсационных взносов;
  - **Требования клиента по возврату ГП/КВ, руб.** — ДС, которые поступят на Лицевой счет в качестве возврата суммы Гарантийных переводов или Компенсационных взносов;
- **Лицевой счет** — обозначение лицевого счета, установленное Регламентом на брокерское обслуживание, действовавшим до 27.03.2014. Заполняется в случае если Плановая дата исполнения требования / обязательства ранее 28.03.2014.

8. Обязательства и требования по сделкам с валютой

- **Дата возникновения** — дата конверсионной сделки, которая привела к возникновению требований или обязательств;
- **Плановая дата исполнения** — плановая дата расчетов по сделке;
- **Номер сделки** — номер конверсионной сделки;
- **Валюта** — предмет сделки;
  - **код** — код валюты, по которой существует обязательство/требование;
  - **объем** — сумма обязательств и требований по сделке в валюте;
- **Сопряженная валюта**
  - **код** — код сопряженной валюты (валюты оплаты Инструмента в конверсионной сделке);
  - **объем** — сумма обязательств и требований по сделке в сопряженной валюте;
- **Комментарий** — доп. информация по операции, н-р, указание на операции по конвертации.

9. Заключенные в отчетном периоде сделки купли/продажи с ценными бумагами

Блок формируется по данным о сделках с ценными бумагами.

- **Инструмент;**
- **Гос. рег. номер;**
- **Номер заявки** — номер заявки не указан, если в поле **Место заключения сделки** указано значение «ВНБР»;
- **Номер сделки;**
- **Дата заключения;**
- **Время заключения;**
- **Плановая дата исполнения** — плановая дата расчёта по сделке;
- **Куплено, шт.;**
- **Продано, шт.;**
- **Валюта цены (номинала для облигаций);**
- **Цена сделки (% для облигаций)** — цена одной ЦБ, для облигаций цена указывается в % от номинала;
- **Валюта расчетов;**
- **Объем сделки в валюте расчетов** — объём сделки в валюте расчетов, включая НКД по сделке в валюте расчетов (для облигаций);
- **НКД по сделке в валюте расчетов** — сумма накопленного купонного дохода в валюте расчетов (для облигаций);
- **Комиссия Брокера/ Доп. комиссия Брокера «Сборы ТС»** — начисленная комиссия по сделке (включает Комиссию Брокера и Дополнительную Комиссию Брокера «Сборы ТС» по сделке, в соответствии с тарифами Брокера и условиями Договора на брокерское обслуживание с Клиентом);
- **Валюта комиссии Брокера;**
- **Место заключения сделки** — неорганизованный рынок (ВНБР) или организатор торгов;
- В случае заключения сделки в Секторе рынка Основной рынок ПАО «Московская биржа» — указывается «ПАО Московская биржа» и режим торгов «Т0» или «Т+» (дополнительно);
- **Комментарий** — дополнительная информация о сделке в торговой системе;
- **Контрагент.**

В конце блока содержатся строки, отражающие итоговые суммы брокерской комиссии в разрезе валюты:

- Итого - Комиссия Брокера / Доп. комиссия Брокера "Сборы ТС" – RUB;
- Итого - Комиссия Брокера / Доп. комиссия Брокера "Сборы ТС" – USD;
- Итого - Комиссия Брокера / Доп. комиссия Брокера "Сборы ТС" – EUR.

Дополнительно в формате отчета xml содержится поле **Примечание** (broker_ref), со значением кода Клиента, по которому совершена сделка. Информация предоставляется справочно и не является обязательной.

10. Заключенные в отчетном периоде сделки РЕПО

Блок формируется по данным о сделках с ценными бумагами.

- **Инструмент;**
- **Гос. рег. номер;**
- **Номер заявки** — номер заявки не указан, если в поле **Место заключения** сделки указано значение «ВНБР»;
- **Номер сделки;**
- **Дата заключения;**
- **Время заключения;**
- **Плановая дата исполнения** — плановая дата расчетов по части сделки РЕПО;
- **Куплено, шт.;**
- **Продано, шт.;**
- **Ставка РЕПО, %;**
- **Валюта цены (номинала для облигаций);**
- **Цена сделки (% для облигаций)** — цена одной ЦБ, для облигаций цена указывается в % от номинала;
- **Валюта расчетов;**
- **Объем сделки в валюте расчетов** — объём части сделки РЕПО в валюте расчетов, включая НКД по сделке в валюте расчетов (для облигаций);
- **НКД по сделке в валюте расчетов** — сумма накопленного купонного дохода по части РЕПО в валюте расчетов (для облигаций);
- **Комиссия Брокера/ Доп. комиссия Брокера «Сборы ТС»** — начисленная комиссия по сделке РЕПО (включает Комиссию Брокера и Дополнительную Комиссию Брокера «Сборы ТС» по сделке, в соответствии с тарифами Брокера и условиями Договора на брокерское обслуживание с Клиентом);
- **Валюта комиссии Брокера;**
- **Место заключения сделки** — неорганизованный рынок (ВНБР) или организатор торгов;
  - В случае заключения сделки в Секторе рынка Основной рынок ПАО «Московская биржа» — указывается «ПАО Московская биржа». Дополнительно, для заключенных в Секторе рынка Основной рынок ПАО «Московская биржа» сделок РЕПО в режиме РЕПО с Центральным Контрагентом указывается «РЕПО с ЦК», иначе — «РЕПО без ЦК»;
- **Сумма погашения НКД** — сумма выплат купона по облигации, в случае если права на получение выплаты получает покупатель по первой части РЕПО, на которую была уменьшена сумма второй части сделки РЕПО;
- **Сумма погашения части основного долга** — сумма выплат в связи с частичным погашением номинала по облигации, в случае если права на получение выплаты получает покупатель по первой части РЕПО, на которую была уменьшена сумма второй части сделки РЕПО;
- **Комментарий** — порядковый номер части РЕПО;
- **Контрагент.**

В конце блока содержатся строки, отражающие итоговые суммы брокерской комиссии в разрезе валюты:

- Итого - Комиссия Брокера / Доп. комиссия Брокера "Сборы ТС" – RUB;

- Итого - Комиссия Брокера / Доп. комиссия Брокера "Сборы ТС" – USD;
- Итого - Комиссия Брокера / Доп. комиссия Брокера "Сборы ТС" – EUR.

Дополнительно в формате отчета xml содержится поле **Примечание** (broker_ref), со значением кода Клиента, по которому совершена сделка. Информация предоставляется справочно и не является обязательной.

11. Заключенные/измененные в отчетном периоде сделки займа ЦБ

- **Инструмент;**
- **Гос. рег. номер;**
- **Операция по сделке займа:**
  - **№** — № операции;
  - **Дата совершения** — дата заключения или изменения сделки займа;
  - **Время совершения** — время заключения или изменения сделки займа;
  - **Плановая дата исполнения** — плановая дата возврата займа;
- **Сделка займа:**
  - **№** — № сделки займа;
  - **Дата заключения** — дата заключения сделки займа;
- **Кол-во ЦБ по сделке, шт.:**
  - **Привлечение** — количество полученных в заем ЦБ;
  - **Размещение** — количество отданных в заем ЦБ;
- **Объем сделки, руб.** — стоимость ЦБ на основании ее рыночной оценки на дату заключения сделки, включая НКД;
- **НКД, руб.** — для облигаций: накопленный купонный доход по сделке;
- **Рыночная стоимость инструмента, руб.** — стоимость ЦБ на основании ее рыночной оценки на дату совершения операции;
- **Ставка, % годовых** — базовая ставка, указанная в процентном выражении к Рыночной стоимости инструмента;
- **Место заключения сделки.**

12. Заключенные в отчетном периоде биржевые конверсионные сделки

- **Инструмент** — предмет сделки.
- **Номер заявки** — номер заявки на покупку / продажу инструмента в торговой системе.
- **Номер сделки** — номер сделки в торговой системе.
- **Дата заключения** — дата заключения сделки.
- **Время заключения** — время заключения сделки.
- **Дата исполнения** — дата исполнения сделки.
- **Направление (B/S)** — направление сделки: «B» — покупка (от англ. Buy), «S» — продажа (от англ. Sell).
- **Кол-во, лоты** — количество купленных / проданных лотов.

- **Цена (план)/Курс сделки, пункты** — плановый курс сделки в пунктах на момент заключения сделки.
- **Цена (факт)/Курс сделки, пункты** — итоговый курс сделки в пунктах.
- **Размер пункта, в единицах сопряженной валюты** — стоимость пункта в единицах сопряженной валюты.
- **Объем в сопряженной валюте** — сумма сделки в сопряженной валюте.
- **Сопряженная валюта** — код валюты, за которую производится покупка / продажа лота.
- **Ком. Брокер / Доп. Ком. Брокера «Сборы в ТС»** — начисленная комиссия по сделке (включает Комиссию Брокера и Дополнительную Комиссию Брокера «Сборы ТС» по сделке, в соответствии с тарифами Брокера и условиями Договора на брокерское обслуживание с Клиентом).
- **Валюта комиссии Брокера** — код валюты, в которой начисляется комиссия Брокера.
- **Комиссия биржи, руб** — комиссия Биржи, начисленная по сделке.
- **Режим** — указывается режим, в котором заключена сделка.
- **Комментарий** — дополнительная информация о сделке.

В конце блока содержатся строки, отражающие итоговые суммы брокерской комиссии в разрезе валюты:

- Итого - Комиссия Брокера / Доп. комиссия Брокера "Сборы ТС" – RUB;
- Итого - Комиссия Брокера / Доп. комиссия Брокера "Сборы ТС" – USD;
- Итого - Комиссия Брокера / Доп. комиссия Брокера "Сборы ТС" – EUR или иная валюта начисления комиссии.

13. Заключенные в отчетном периоде биржевые сделки СВОП

- **Инструмент** — предмет сделки.
- **Номер заявки** — номер заявки на покупку / продажу в торговой системе.
- **Номер сделки** — номер сделки в торговой системе.
- **Дата заключения** — дата заключения сделки (первой части).
- **Время заключения** — время заключения сделки.
- **Дата исполнения 1части —** дата исполнения первой части.
- **Дата исполнения 2 части** — плановая дата исполнения второй части.
- **Направление 1 части (B/S)** — направление сделки: «B» — покупка (от англ. Buy), «S» — продажа (от англ. Sell).
- **Кол-во, лоты** — количество купленных / проданных лотов.
- **Цена сделки, пункты** — итоговый курс 1-ой части сделки СВОП в пунктах.
- **Размер пункта, в единицах сопряженной валюты** — размер пункта измерения цены в единицах сопряженной валюты.
- **Объем в сопряженной валюте 1 части** — объем 1-ой части сделки в сопряженной валюте.
- **Сопряженная валюта** — код валюты, за которую производится покупка / продажа лота.

- **Ком. Брокер / Доп. Ком. Брокера «Сборы в ТС»** — начисленная комиссия по сделке (включает Комиссию Брокера и Дополнительную Комиссию Брокера «Сборы ТС» по сделке, в соответствии с тарифами Брокера и условиями Договора на брокерское обслуживание с Клиентом).
- **Валюта комиссии Брокера** — код валюты, в которой начисляется комиссия Брокера.
- **Комиссия биржи, руб** — комиссия Биржи, начисленная по сделке.
- **Режим** — указывается режим, в котором заключена сделка.
- **Комментарий** — дополнительная информация о сделке.

Сделка СВОП отражается одной строкой по данным 1-й части.

В конце блока содержатся строки, отражающие итоговые суммы брокерской комиссии в разрезе валюты:

- Итого - Комиссия Брокера / Доп. комиссия Брокера "Сборы ТС" – RUB;
- Итого - Комиссия Брокера / Доп. комиссия Брокера "Сборы ТС" – USD;
- Итого - Комиссия Брокера / Доп. комиссия Брокера "Сборы ТС" –EUR или иная валюта начисления комиссии.

14. 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))**.**

15. Завершенные в отчетном периоде сделки купли/продажи с ценными бумагами

Блок формируется по данным о сделках с ценными бумагами.

- **Инструмент;**
- **Гос. рег. номер;**
- **Номер заявки** — Номер заявки не указан, если в поле **Место заключения сделки** указано значение «ВНБР»;
- **Номер сделки;**
- **Дата заключения;**
- **Дата исполнения (план)** — плановая дата расчетов по сделке;
- **Дата исполнения (факт)** — фактическая дата расчетов по сделке;
- **Куплено, шт.;**
- **Продано, шт.;**
- **Валюта цены (номинала для облигаций);**
- **Цена сделки (% для облигаций)** — цена одной ЦБ, для облигаций цена указывается в % от номинала;
- **Курс для расчетов** — курс для расчета объема сделки и НКД в валюте расчетов по сделке. Если валюта расчетов совпадает с валютой сделки, курс для расчетов устанавливается равным «1»;
- **Валюта расчетов;**
- **Объем сделки в валюте расчетов** — объём сделки в валюте расчетов, включая НКД по сделке в валюте расчетов (для облигаций);
- **НКД по сделке в валюте расчетов** — сумма накопленного купонного дохода в валюте расчетов (для облигаций);
- **Место заключения сделки** — неорганизованный рынок (ВНБР) или организатор торгов;
  - В случае заключения сделки в Секторе рынка Основной рынок ПАО «Московская биржа» — указывается «ПАО Московская биржа» и режим торгов «Т0» или «Т+» (дополнительно);
- **Лицевой счет** — обозначение лицевого счета, установленное Регламентом на брокерское обслуживание, действовавшим до 27.03.2014. Заполняется для сделок с датой заключения ранее 28.03.2014;
- **Комментарий** — дополнительная информация о сделках в торговой системе.

Дополнительно в формате отчета xml содержится поле **Примечание** (broker_ref), со значением кода Клиента, по которому совершена сделка. Информация предоставляется справочно и не является обязательной.

16. Завершенные в отчетном периоде сделки РЕПО

Блок формируется по данным о сделках с ценными бумагами.

- **Инструмент;**
- **Гос. рег. номер;**
- **Номер заявки** — номер заявки не указан, если в поле **Место заключения сделки** указано значение «ВНБР»;

- **Номер сделки;**
- **Дата заключения;**
- **Дата исполнения (план)** — плановая дата расчетов по части сделки РЕПО;
- **Дата исполнения (факт)** — фактическая дата расчетов по части сделки РЕПО;
- **Куплено, шт.;**
- **Продано, шт.;**
- **Валюта цены (номинала для облигаций);**
- **Цена сделки (%для облигаций)** — цена одной ЦБ, для облигаций цена указывается в % от номинала;
- **Курс для расчетов** — курс для расчета объема сделки и НКД в валюте расчетов по сделке. Если валюта расчетов совпадает с валютой сделки, курс для расчетов устанавливается равным 1;
- **Валюта расчетов;**
- **Объем сделки в валюте расчетов** — объём части сделки РЕПО в валюте расчетов, включая НКД по сделке в валюте расчетов (для облигаций);
- **НКД по сделке в валюте расчетов** — сумма накопленного купонного дохода по части сделки РЕПО в валюте расчетов (для облигаций);
- **Место заключения сделки** — неорганизованный рынок (ВНБР) или организатор торгов;
  - В случае заключения сделки в Секторе рынка Основной рынок ПАО «Московская биржа» указывается «ПАО Московская биржа». Дополнительно для заключенных в Секторе рынка Основной рынок ПАО «Московская биржа» сделок РЕПО в режиме РЕПО с Центральным Контрагентом — указывается «РЕПО с ЦК», иначе — «РЕПО без ЦК»;
- **Лицевой счет** — обозначение лицевого счета, установленное Регламентом на брокерское обслуживание, действовавшим до 27.03.2014. Заполняется для сделок с датой заключения ранее 28.03.2014;
- **Сумма погашения НКД** — сумма выплат купона по облигации, в случае если права на получение выплаты получает покупатель по первой части РЕПО, на которую была уменьшена сумма второй части сделки РЕПО;
- **Сумма погашения части основного долга** — сумма выплат в связи с частичным погашением номинала по облигации, в случае если права на получение выплаты получает покупатель по первой части РЕПО, на которую была уменьшена сумма второй части сделки РЕПО;
- **Комментарий** — порядковый номер части РЕПО.

Дополнительно в формате отчета xml содержится поле **Примечание** (broker_ref), со значением кода Клиента, по которому совершена сделка. Информация предоставляется справочно и не является обязательной.

17. Расчеты по сделкам займа ЦБ

- **Инструмент;**
- **Гос. рег. номер;**
- **Дата расчетов по сделкам (факт);**
- **Операция по сделке займа:**
  - **№** — № операции;
  - **Дата совершения** — дата заключения или изменения сделки займа;

- **Кол-во ЦБ по сделке, шт.:**
  - **Привлечение** — количество полученных в заем ЦБ;
  - **Размещение** — количество отданных в заем ЦБ;
- **Рыночная стоимость ЦБ, руб.** — стоимость ЦБ на основании ее рыночной оценки на дату совершения операции;
- **Расчеты по ЦБ, шт.:**
  - **Возникновение/изменение обязательств:**
- **Выдача** — количество ЦБ, фактически переданное в заем от кредитора заемщику;
- **Первоначальный срок** — количество выданных ранее ЦБ, определенное в операции изменения, которая совершена в Дату расчетов по сделкам (факт);
  - **Прекращение/изменение обязательств:**
- **Возврат** — количество ЦБ, фактически переданное от заемщика кредитору как возврат займа;
- **Первоначальный срок** — количество ЦБ, не возвращенных кредитору, для возврата которых операцией изменения определена новая дата;
- **Расчеты по ДС:**
  - **Валюта расчетов;**
  - **Доход по сделке** — сумма % по займу;
  - **Комиссия брокера, руб.;**
- **Лицевой счет** — обозначение лицевого счета, установленное Регламентом на брокерское обслуживание, действовавшим до 27.03.2014. Заполняется для сделок с датой заключения ранее 28.03.2014.

18. Расчеты по конверсионным сделкам

- **Номер сделки** — номер сделки в торговой системе.
- **Дата заключения** — дата заключения сделки.
- **Дата исполнения** — плановая дата исполнения сделки.
- **Направление (B\S)** — направление сделки: «B» — покупка (от англ. Buy), «S» — продажа (от англ. Sell).
- **Валюта — предмет сделки**
  - **код** — код валюты.
  - **объем** — сумма сделки.
- **Сопряженная валюта**
  - **код** — код сопряженной валюты (валюты оплаты Инструмента в конверсионной сделке).
  - **объем** — сумма сделки в сопряженной валюте.
- **Цена (факт)/Курс, пункты** — итоговый курс сделки в пунктах.
- **Размер пункта в сопряженной валюте** — стоимость пункта в сопряженной валюте.

19. 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))**.**

20. Незавершенные сделки с ценными бумагами прошлых периодов[3]

Блок формируется по данным о незавершенных сделках с ценными бумагами.

- **Инструмент;**
- **Гос. рег. номер;**
- **Номер заявки** — Номер заявки не указан, если в поле **Место заключения сделки** указано значение «ВНБР»;
- **Номер сделки;**
- **Дата заключения;**
- **Дата исполнения (план)** — плановая дата расчётов по сделке или по части сделки РЕПО;
- **Куплено, шт.;**
- **Продано, шт.;**
- **% ставка для РЕПО;**
- **Валюта цены (номинала для облигаций);**
- **Цена сделки (% для облигаций)** — цена одной ЦБ, для облигаций цена указывается в % от номинала;
- **Валюта расчетов;**

[3] Сделки купли/продажи и части сделок РЕПО.

- **Объем сделки в валюте расчетов** — объём сделки (части сделки РЕПО) в валюте расчетов, включая НКД по сделке в валюте расчетов (для облигаций);
- **НКД по сделке в валюте расчетов** — сумма накопленного купонного дохода по сделке (части сделки РЕПО) в валюте расчетов (для облигаций);
- **Место заключения сделки** — неорганизованный рынок (ВНБР) или организатор торгов;
  - В случае заключения сделки в Секторе рынка Основной рынок ПАО «Московская биржа» — указывается «ПАО Московская биржа». Дополнительно для заключенных в Секторе рынка Основной рынок ПАО «Московская биржа» сделок РЕПО в режиме РЕПО с Центральным Контрагентом — указывается «РЕПО с ЦК», иначе — «РЕПО без ЦК», для сделок купли-продажи указывается режим торгов «Т0» или «Т+»;
- **Сумма погашения НКД** — сумма выплат купона по облигации, в случае если права на получение выплаты получает покупатель по первой части РЕПО, на которую была уменьшена сумма второй части сделки РЕПО;
- **Сумма погашения части основного долга** — сумма выплат в связи с частичным погашением номинала по облигации, в случае если права на получение выплаты получает покупатель по первой части РЕПО, на которую была уменьшена сумма второй части сделки РЕПО;
- **Комментарий** — дополнительная информация о типе сделки в торговой системе или порядковом номере сделки РЕПО;
- **Контрагент.**

Дополнительно в формате отчета xml содержится поле **Примечание** (broker_ref), со значением кода Клиента, по которому совершена сделка. Информация предоставляется справочно и не является обязательной.

21. Незавершенные сделки займа ЦБ заключенные / измененные в прошлых периодах

- **Инструмент;**
- **Гос. рег. номер;**
- **Операция по сделке займа:**
  - **№** — № операции;
  - **Дата совершения** — дата заключения или изменения сделки займа;
  - **Время совершения** — время заключения или изменения сделки займа;
  - **Плановая дата исполнения** — плановая дата возврата займа;
- **Сделка займа:**
  - **№** — № сделки займа;
  - **Дата совершения** — дата заключения сделки займа;
- **Кол-во ЦБ по сделке, шт.:**
  - **Привлечение** — количество полученных в заем ЦБ;
  - **Размещение** — количество отданных в заем ЦБ;
- **НКД, руб.** — для облигаций накопленный купонный доход по сделке;
- **Объем сделки, руб.** — стоимость ЦБ на основании ее рыночной оценки на дату заключения сделки, включая НКД;
- **Рыночная стоимость инструмента, руб.** — стоимость ЦБ на основании ее рыночной оценки на дату совершения операции;

- **Ставка, % годовых** — базовая ставка, указанная в процентном выражении к Рыночной стоимости инструмента;
- **Место заключения сделки.**

22. 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))**.**

23. Срочные сделки с производными финансовыми инструментами

В данном разделе отчета в табличном виде представлены все сделки со срочными контрактам на биржевом срочном рынке, которые были отнесены на счет Клиента за отчетную дату. Сделки сгруппированы по типу контрактов. Внутри группы сделки расположены в хронологическом порядке.

- **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;
- **Дата клиринга** – дата расчета по сделке;
- **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, купленные на разных площадках, по каждой из них в отчете будет несколько строк);
- **Комментарий** — комментарий.

24. Исполнение опционов

- **Контракт** — код исполненного опционного контракта;
- **Код контракта** — код контракта;
- **Куплено, шт.** — 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, шт.** — 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.

25. Исполнение

- **Контракт** — тип контракта;
- **Код контракта** — код контракта;
- **Куплено, шт.** — 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, шт.** — 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;
- **Последняя цена** — цена последней сделки;
- **Цена** – цена закрытия;

- **Организатор торговли** — сокращенное наименование организатора торговли, на площадке которого совершена операция исполнения контракта.

26. Прочие зачисления / списания ценных бумаг

- **Дата;**
- **Площадка** — если дата операции ранее 28.03.2014, указывается обозначение Площадки, установленное Регламентом на брокерское обслуживание, действовавшим до 27.03.2014.
- **Инструмент;**
- **Гос. рег. номер;**
- **Количество;**
- **Описание** — расшифровка типа операции.

27. Операции блокировки ЦБ

- **Наименование ЦБ –** инструмент;
- **Дата блокировки;**
- **Дата разблокировки;**
- **Кол-во, шт. –** количество заблокированных ЦБ. Количество разблокированных бумаг указано со знаком «-» (минус);
- **Тип –** тип блокировки (например, корпоративное событие, судебное предписание);
- **Комментарий –** основание для блокировки**.**

28. Справочник финансовых инструментов

- **Инструмент;**
- **Номер гос. регистрации;**
- **Организатор торговли;**
- **Эмитент;**
- **ISIN;**
- **Тип;**
- **Прив.** — краткое наименование типа инструмента («АО» — акция обыкновенная, «АП» — акция привилегированная, «ОБ» — облигация, «П» — пай, «AD» — ADR, «GD» — GDR);
- **Номинал;**
- **Валюта номинала;**
- **Размер лота;**
- **НКД на одну ЦБ в рублях** – накопленный купонный доход (для облигаций) на одну ЦБ на конец Периода отчета в рублях;
- **НКД на одну ЦБ, в валюте номинала** — накопленный купонный доход (для облигаций) на одну ЦБ на конец Периода отчета в валюте номинала;
- **Рыночная цена, руб. (% для обл.)** — Рыночная цена (Рыночная цена, определенная в соответствии с Порядком определения рыночной цены ЦБ, расчетной цены ЦБ, а также предельной границы колебаний рыночной цены ЦБ в целях 23 главы Налогового кодекса Российской Федерации, утвержденным приказом Федеральной службы по финансовым рынкам от 09.11.2010 № 10-65/пз-н) на конец Периода отчета;

- **Тикер** — код инструмента данного Организатора торговли.

29. Детализация сумм обязательств Клиента по возврату доходов

- **Эмитент;**
- **Дата фиксации реестра** — дата «закрытия реестра» (дата составления списка лиц, имеющих право на участие в собрании акционеров Эмитента);
- **Сумма**— расчет суммы производится в соответствии с разделом 9 статьи 5 Регламента обслуживания клиентов АО «Открытие Брокер» (Приложение 1 к Договору на брокерское обслуживание и Договору ИИС);
- **Валюта** — код валюты.

Под отчетом:

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