# 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"
	<ul> <li>"Операции в торговой системе (адресные сделки): RTS Standard"</li> </ul>
	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	В разделе 5. Операции в торговой системе: блок Операции в торговой
	системе: Фьючерсы и Опцины переименован в Операции в торговой
07.00.0040	системе. В указанном блоке изменено значение поля «Вид».
27.03.2013	В раздел 5. Операции в торговой системе в блок Операции в торговой системе (адресные сделки и РЕПО): РТС Стандарт добавлено поле «№ сделки РЕПО».
	В раздел 2. Задолженности / Обязательства клиента перед Брокером: добавлены новые поля «Валюта» и «Код валюты».
6.09.2013	Внесены уточнения о зависимости статуса отчета сформированного в Личном кабинете от времени формирования отчета.
20.09.2013	Наименование раздела <b>Задолженности клиента</b> переименовано в <b>2</b> . Задолженности / Обязательства клиента перед Брокером:
8.09.2013	Внесены правки в наименование торговых систем.
27.03.2014	Внесены изменения в наименование отчета и структуру заголовка.
12.11.2014	В разделе 6. Исполнение опционов:
	<ul> <li>название поля Код переименовано в Код контракта;</li> <li>добавлены поля Организатор торговли и Операция;</li> <li>внесены уточнения в описание полей Куплено, Продано и Цена.</li> </ul>

# Содержание:

Содержание:	1
Форматы отчетов	
В заголовке отчета указаны:	
1. Сводная информация по счету клиента:	
2. Задолженности / Обязательства клиента перед Брокером:	
3. Гарантийные обязательства:	
4. Открытые позиции:	
5. Операции в торговой системе	
6. Исполнение опционов:	
7. Движение денежных средств:	
Под отчетом:	

В отчетах отображается информация о сделках, совершенных Вами, в течение отчетного периода на Срочных рынках ОАО «Московская биржа» (FORTS), ОАО «Санкт-Петербургская биржа», ОАО «Мосэнергобиржа», РТС СТАНДАРТ (до 27.03.2014) или Срочном рынке СПбМТСБ 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 так же 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 и в разделе **По счету** выберите соответствующее значение:

- «суммарно по клиенту» для формирования отчета по всем счетам Клиента;
- «суммарно по счету» для формирования отчета по всем субсчетам Клиента:
- необходимый счет / субсчет для формирования отчета по конкретному счету / субсчету Клиента.

# В заголовке отчета указаны:

- Дата или период, за который сформирован отчет.
- Информация о клиенте:
  - **Клиент** номер инвестиционного счета, ФИО Клиента или наименование юридического лица Клиента.
  - Договор на брокерское обслуживание номер и дата договора на брокерское обслуживание.
  - □ **Портфель** Срочный рынок FORTS (CP 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:

**Входящий остаток** — сумма денежных средств, которая была на счете Клиента на начало торгового дня. Входящий остаток равен исходящему остатку за предыдущий торговый день.

Вариационная маржа — сумма вариационной маржи по всем контрактам. Вариационная маржа определяется по каждой позиции по фьючерсному контракту или опционному контракту в соответствии со Спецификацией фьючерсного контракта или Спецификацией опционного контракта:

- 1. По Контракту, по которому расчет вариационной маржи ранее не осуществлялся, Вариационная маржа определяется как денежное выражение разницы между ценой заключения контракта и расчетной ценой текущего клирингового сеанса.
- 2. По Контракту, по которому расчет вариационной маржи осуществлялся ранее, Вариационная маржа определяется как денежное выражение разницы между расчетной ценой предыдущего и текущего клирингового сеанса.

**Гарантийный перевод** — сумма Гарантийных переводов 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.

**Исходящий остаток** — сумма денежных средств (ДС), 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).

**Исходящий остаток с учетом опционов (справочно)** — сумма ДС на счете Клиента, 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 отчетный период, например, вознаграждение брокера, комиссия биржи и прочее.

#### Пример:

Пусть входящий остаток на счете равен 100 000 рублей, куплено 10 фьючерсных контрактов на акции РАО ЕЭС, продано 10 фьючерсных контрактов на акции ОАО "Лукойл". За торговый день фьючерсный контракт на акции РАО ЕЭС подорожал на 100 пунктов, фьючерсный контракт на акции ОАО "Лукойл" подешевел на 50 пунктов.

В ходе торговой сессии было куплено 5 опционов на фьючерсный контракт на акции РАО ЕЭС по цене 50 рублей за опцион, котировка на конец дня — 70. Кроме

того, совершались внутри дневные операции с акциями ОАО "Ростелеком" и РАО ЕЭС.

Была подана заявка на вывод 20 000 рублей и получение данной суммы наличными в кассе брокера.

Тогда первый раздел отчета будет выглядеть следующим образом:

Входящий остаток:	100 000,00
Движение средств:	-20 000,00
Вознаграждение брокера:	-330,00
Вариационная маржа:	1290,00
Премия по опциону:	-250,00
Доп. комиссия:	-200,00
Исходящий остаток	80 510,00
Исходящий остаток с учетом опционов (справочно):	80 860,00

**Примечание:** дополнительная комиссия была списана брокером за выдачу наличных из кассы в размере 1% от суммы. При выводе на расчетный счет дополнительная комиссия не взимается.

# 2. 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.
- 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.

# 3. Гарантийные обязательства:

В этом разделе отображаются требуемое гарантийное обеспечение для поддержания открытых позиций. Пусть требуемое ГО по фьючерсному контракту на акции РАО ЕЭС равно 600 рублей, а по фьючерсному контракту на акции ОАО "Лукойл" равно 900 рублей, тогда, по условиям предыдущего примера, таблица будет выглядеть следующим образом:

Требуемый гарантийный взнос	15 000,00
Дополнительный гарантийный взнос	0,00
В том числе деньгами	15 000,00

**Требуемый гарантийный взнос** — сумма требуемого ГО для поддержания открытых фьючерсных и опционных (только при продаже опционов) позиций.

**Дополнительный гарантийный взнос** — сумма дополнительного ГО, назначенного биржей или брокером.

В том числе деньгами — сумма ГО, внесенная денежными средствами.

Примечание: ГО может быть внесено частично ценными бумагами.

Свободный остаток средств и требования по внесению дополнительных средств гарантийного обеспечения отображаются в виде следующих двух таблиц.

Свободный остаток средств	65 510
В том числе денежных	65 510

**Свободный остаток средств** — денежная оценка активов, свободных от обязательств.

В том числе денежных — денежные средства, свободные от обязательств.

Требуется довнести	0,00
В том числе деньгами	0,00

**Требуется довнести** — денежная оценка активов, требуемых дополнительно для поддержания открытых позиций на счете Клиента.

**В том числе деньгами** — минимальная величина денежных средств, требуемая дополнительно для поддержания открытых позиций на счете Клиента.

**Примечание**: в соответствии с текущим нормативом ликвидности ГО, денежных средств должно быть не менее 50% от общей величины ГО.

# 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. Операции в торговой системе

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. Операции в торговой системе:

- Контракт тип контракта.
- Код контракта код контракта.
- № заявки номер заявки на покупку или продажу контракта в торговой системе.
- Идентификатор/ Homep 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. Операции в торговой системе: 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.Операции в торговой системе (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 опционов:

- **Контракт** код исполненного опционного контракта.
- **Код контракта** 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.

# 7. Движение денежных средств:

- Дата дата зачисления / списания ДС.
- **Организатор** сокращенное наименование организатора торговли, на площадке которого была проведена операция.
- **Сумма**, руб. сумма зачисленных / списанных ДС.
- Комментарии описание операции.

#### Под отчетом:

В нижней части отчета указаны ФИО и должность сотрудника ОАО "Брокерский дом "ОТКРЫТИЕ", ответственного за составление отчета.