Инструкция по чтению отчета СТРУКТУРНЫЕ ПРОДУКТЫ (СР СП)

Изменения:

Дата изменения	Описание изменения
27.03.2013	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	Раздел **Задолженности клиента** переименован в **Задолженности / Обязательства Клиента перед Брокером:**
27.03.2014	Изменения в наименовании отчета и в структуре заголовка.
27.05.2014	Добавлен блок **Требования и обязательства по Гарантийным переводам / Гарантированным платежам:**
17.11.2015	Изменено наименование Брокера.
5.04.2016	Изменено название раздела **Операции в торговой системе**. Новое название **Срочные сделки с производными финансовыми инструментами**.
08.02.2017	Добавлен блок **7. Исполнение опционов**
07.04.2017	Наименование блока **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.

Содержание:

Содержание: 1
Форматы отчетов 2
В заголовке отчета указаны: 2
1. Сводная информация по счету клиента: 2
2. Требования к обеспечению 3
3. Задолженности / Обязательства Клиента перед Брокером: 4
4. Открытые позиции: 4
5. Срочные сделки с производными финансовыми инструментами: 4
6. Исполнение: 5
7. Исполнение опционов: 5
8. Прочие зачисления/ списания денежных средств: 6
9. Требования и обязательства по Гарантийным переводам / Гарантированным платежам: 6
Под отчетом: 6

В отчетах отображается информация о внебиржевых сделках с производными финансовыми инструментами (ВПФИ), совершенных Вами в течение отчетного периода в рамках портфеля Структурные Продукты (СР СП) 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

Для того чтобы получить отчет (за конкретную дату или период) необходимо зайти в личный кабинет и выбрать в разделе **По счету** значение:

- «суммарно по клиенту» - для того, чтобы получить отчет (за конкретную дату или период) по всем счетам Клиента;
- «суммарно по счету» - для того, чтобы получить отчет (за конкретную дату или период) по всем субсчетам Клиента;
- счет / субсчет - для того, чтобы получить отчет (за конкретную дату или период) по конкретному счету / субсчету Клиента.

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

В заголовке отчета указаны:

- Дата или период, за который сформирован отчет;
- Информация о Клиенте:
  - **Клиент** — номер инвестиционного счета, ФИО Клиента или наименование юридического лица;
  - **Договор на брокерское обслуживание** — номер и дата договора на брокерское обслуживание;
  - **Портфель** — Структурные продукты (СР СП);
  - **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. – для Портфеля СР СП не заполняется.

- **Входящий остаток (факт)** — сумма денежных средств (ДС) 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;
- **Вариационная маржа/ Сумма выплаты** — сумма вариационной маржи/ сумма выплаты, уплаченная/ полученная по всем контрактам, определяется по каждой позиции по срочному контракту в соответствии со Спецификацией срочного контракта.
- **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;
- **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 отчетный период, например, Комиссия Брокера/ Доп. комиссия Брокера «Сборы ТС» за заключение сделок, 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. Для иностранных валют указывается курс Банка России, 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. 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, когда образовалась задолженность;
- **Начислено в валюте** — сумма задолженности Клиента 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. 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 /продажи контракта;
- **Позиция, лоты/шт.** — количество купленных/ проданных контрактов по одной и той же цене;
- **Котировка** — котировка;
- **Текущая стоимость** — произведение позиции на котировку;
- **Организатор торговли** — сокращенное наименование организатора торговли («ВНБР»).

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, которые были отнесены на счет Клиента за отчетный период. Сделки сгруппированы по типу контрактов («Фьючерс/ форвард/ своп» и «Опционы»). Внутри группы сделки расположены в хронологическом порядке.

Примечание. Внимательно проверьте соответствие представленных в отчете данных вашим записям и в случае возникновения разночтений немедленно сообщите об этом брокеру.

- **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 («ВНБР»);
- **Комментарий** — комментарий.

6. Исполнение:

- **Контракт** — тип исполненного контракта;
- **Код контракта** — код исполненного контракта;
- **Куплено, шт** - количество исполненных проданных внебиржевых срочных контрактов (ВПФИ, кроме опционов);
- **Продано, шт** - количество исполненных купленных внебиржевых срочных контрактов (ВПФИ, кроме опционов);
- **Последняя цена** — для ВПФИ не транслируется;
- **Цена** — для ВПФИ не транслируется;
- **Организатор торговли** — сокращенное наименование организатора торговли, на площадке которого совершена операция исполнения контракта, для ВПФИ – внебиржевой рынок (ВНБР).

7. Исполнение опционов:

- **Контракт** – код исполненного опционного контракта;
- **Код контракта** — код контракта;
- **Куплено, шт** — количество проданных опционных контрактов, которые исполнились по инициативе покупателя или срок обращения которых истек;
- **Продано, шт** - количество купленных опционных контрактов, исполненных по инициативе покупателя или 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, для ВПФИ – внебиржевой рынок (ВНБР);
- **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 по счету Клиента в Валюте.
- **Описание** – расшифровка типа операции.

9. Требования и обязательства по Гарантийным переводам / Гарантированным платежам:

- **Сумма (валюта)** — сумма требований и обязательств по ГП, уплаченным или полученным по незавершенным сделкам с ПФИ по портфелю СР СП по состоянию на конец периода отчета, по валюте платежа. По уплаченному Клиентом ГП сумма указывается со знаком ″−″, по полученному — со знаком ″+″.
- **Валюта** — код валюты платежа.
- **Сумма, руб —** произведение **Суммы (валюта)** на курс валюты к рублю, установленный ЦБ РФ на дату окончания периода отчета. По уплаченному Клиентом ГП сумма указывается со знаком ″−″, по полученному — со знаком ″+″.

  В нижней строке блока выводится итоговая сумма по столбцу **Сумма, руб**.

Под отчетом:

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