

Раскрытие информации профессионального участника

АО «Альфа-Банк» · контур экосистемы «Единство» · редакция 08.2026

1. Предмет и область применения

Документ фиксирует стандарты, применяемые деском «Единство» при работе через АО «Альфа-Банк» в рамках торгово-исполнительного контура. Область применения охватывает маркет-мейкерские мандаты на организованных торгах, поддержание двусторонних котировок, управление инвентарём и сопутствующие расчётные операции.

Требования распространяются на трейдинг-деск, риск-функцию, бэк-офис и комплаенс экосистемы, а также на подключаемых советников и корпоративных клиентов в части операций, проходящих через указанный контур.

2. Нормативная рамка

Стандарты выстроены с учётом требований законодательства Российской Федерации о рынке ценных бумаг, нормативных актов Банка России, правил организатора торговли и клиринговой организации, а также внутренних политик банка-партнёра.

При расхождении между настоящим документом и правилами торгов или регламентом банка-партнёра приоритет имеют правила организатора торговли и регламент партнёра.

3. Операционные параметры

Параметры контура фиксируются в мандате и пересматриваются не реже одного раза в квартал по итогам отчёта об исполнении (ТСА) и обзора лимитов.

Параметр	Значение / порядок
Режим расчётов	T+0 / T+1 / T+2 в зависимости от инструмента и режима торгов
Сегрегация активов	Мастер-счёт деска и субсчёта по мандатам; обособленный учёт клиентских позиций
Контроль лимитов	Pre-trade проверки: лимит нотионала, дельта-лимит, лимит просадки, kill-switch
Отчётность	Ежедневный отчёт по исполнению, недельный KPI-отчёт по спреду и присутствию в стакане
Сверка	Двусторонняя сверка позиций и денежных остатков по итогам расчётного дня

4. Управление рисками и непрерывность

Рыночный риск ограничивается дельта-нейтральными конструкциями, лимитами на инвентарь и стоп-политикой по просадке. Кредитный и расчётный риск контролируются через сегрегацию, лимиты на контрагента и требования к обеспечению.

Операционная непрерывность обеспечивается резервными каналами подключения, дублированием шлюзов и процедурой ручного вывода котировок при деградации канала. Инциденты фиксируются в журнале и разбираются в течение одного рабочего дня.

5. Комплаенс и раскрытие информации

Деск применяет процедуры ПОД/ФТ, идентификации клиента и контроля источников средств, соответствующие требованиям банка-партнёра. Конфликты интересов выявляются и раскрываются до заключения мандата.

Персональные данные обрабатываются в объёме, необходимом для исполнения мандата, с соблюдением требований законодательства о персональных данных и внутренних политик информационной безопасности.

6. Порядок предоставления полного комплекта

Полный комплект документов по конкретному мандату, включая тарифные приложения и формы поручений, предоставляется деском «Единство» по письменному запросу уполномоченного представителя компании. Срок подготовки комплекта — до двух рабочих дней.

7. Состав раскрываемой информации

Раскрытию подлежат: сведения о лицензиях профессионального участника, структура тарифов, порядок рассмотрения обращений, перечень рисков операций на финансовых рынках, а также данные о лицах, входящих в контур исполнения.

Актуальная редакция раскрытия поддерживается банком-партнёром; деск экосистемы обеспечивает соответствие своих операционных регламентов раскрытым условиям.

Документ носит информационный характер, описывает операционные стандарты взаимодействия деска «Единство» с банком-партнёром и не является рекламой продуктов третьих лиц, инвестиционной рекомендацией или публичной офертой.