

Утверждено Решением Совета директоров АО «Фридом Финанс»
Протокол № 02/23 от 23 февраля 2017 г.

Уведомление о рисках

(при совершении операций репо с неттингом)

1. Настоящее уведомление о рисках является Приложением к Правилам осуществления операций репо с неттингом Акционерного общества «Фридом Финанс» (далее – Общество).

Цель уведомления - предупредить Клиента о возможных убытках, связанных с заключением подобных сделок и призвано помочь Клиенту понять риски этого вида сделок.

2. Помимо основных рисков, связанных с проведением операций на фондовом рынке, при совершении операций репо с неттингом возникают специфические риски, характерные именно для данного вида операций:

2.1. При совершении операций репо с неттингом, Клиент несет ценовой риск. Ценовой риск – риск неожиданного изменения цен на ценные бумаги, которое может привести к падению стоимости портфеля Клиента и, как следствие, снижению доходности или даже прямым убыткам.

2.2. Клиент обязуется погасить все обязательства, возникшие по операциям репо с неттингом, при этом рыночная стоимость ценных бумаг в течение дня может существенно измениться. Совершая сделки репо с неттингом, Клиент осознает все риски, связанные с изменением рыночной цены на ценные бумаги и обязуется погасить возникшие обязательства вне зависимости от изменения рыночной конъюнктуры.

2.3. Риск ликвидности - риск, связанный с возможным невыполнением либо несвоевременным выполнением обязательств. Риск потери ликвидности ценных бумаг как активов определяется возможностью их быстрой реализации с низкими издержками и по приемлемым ценам.

2.4. Процентный риск - риск возникновения расходов (убытков) вследствие неблагоприятного изменения ставок вознаграждения по репо.

2.5. Следует учесть, что при осуществлении Клиентом операции репо с неттингом взимаются комиссии, выплата Клиентом которых уменьшает чистую прибыль или увеличивает его убытки.

3. Дополнительным фактором, влияющим на увеличение степени риска, является требование по поддержанию необходимого уровня достаточности средств на брокерском счете Клиента. Если значение текущего уровня достаточности средств будет уменьшаться, Общество потребует от клиента совершение определенных действий с целью доведения его до требуемой величины. Это может повлечь необходимость реализации части активов Клиента вне зависимости от состояния рыночных цен и последующих убытков от такой продажи.

4. Если размер обеспечения на брокерском счете Клиента ниже установленного значения допустимого уровня, Общество вправе (с уведомления Клиента) принудительно закрыть позицию/приостановить все операции Клиента кроме операций восстановления допустимого уровня обеспечения. При этом Клиент будет нести ответственность по внесению дополнительного обеспечения, дефицит которого может возникнуть при закрытии позиции Клиента.

5. Подписание Клиентом Заявления о присоединении к Договору на брокерское обслуживание (с номинальным держанием), а также ознакомление Клиента с Регламентом брокерской и дилерской деятельности Акционерного общества «Фридом Финанс» и уведомлениями об ограничениях и особых условиях, установленных законодательством РК в отношении сделок с ценными бумагами, которые предполагаются к совершению (совершенных) Клиентом и настоящим Уведомлением о рисках, возникающих при совершении Клиентом сделок репо с неттингом, размещенных на официальном ресурсе Общества www.almaty-ffin.kz означает, что Клиент осознает все возможные риски, возникающие при совершении операций репо с неттингом, и принимает их в полном объеме.