



Утверждено

И.о. директора ООО «ТАИФ-ИНВЕСТ»

Приказ № 56 от «04» августа 2021г.

Владина И.Ф.

МЕТОДИКА определения фактического риска Учредителя управления ООО «ТАИФ-ИНВЕСТ»

1. Настоящая Методика определения фактического риска Учредителя управления (далее – Методика) разработана ООО «ТАИФ-ИНВЕСТ» в соответствии с требованиями, установленными Базовым стандартом совершения управляющим операций на финансовом рынке, утвержденным НАУФОР, и иными нормативными правовыми актами РФ.

2. Термины, используемые в настоящей Методике, используются в значении, которое придается Методикой определения инвестиционного профиля Учредителя управления ООО «ТАИФ-ИНВЕСТ» и раскрытым на официальном сайте в сети Интернет, договором доверительного управления, заключенным с Учредителем управления, а при отсутствии в указанных документах определений таких терминов – в значении, придаваемом таким терминам действующими нормативными правовыми актами РФ.

3. Фактический риск (R) – риск, который несет Учредитель управления за определенный период времени (включает в себя риск убытков, в том числе риск изменения стоимости активов).

4. Размер Фактического риска не должен превышать уровень Допустимого риска, соответствующего инвестиционному профилю Учредителя управления.

5. Фактический риск Доверительный управляющий определяет при осуществлении доверительного управления Активами Учредителя управления, не являющегося квалифицированным инвестором на регулярной основе не реже 1 раза в неделю (по состоянию на последний рабочий день недели) отдельно по каждому договору доверительного управления Учредителя управления.

Фактический риск Учредителя управления рассчитывается в следующем порядке:

$$R = (PTV2 + ДС_{\text{вывод}} - ДС_{\text{ввод}} - PTV1) / PTV * 100\%$$

где: R – размер фактического риска Клиента (в % от стоимости Портфеля Учредителя управления);

Расчетный период – период с начала инвестиционного горизонта до даты, на которую производится определение соответствия фактического риска допустимому риску;

PTV – средневзвешенная сумма вложенных средств с учетом вводов/выводов;

PTV2 – стоимость Активов Учредителя управления на дату расчета (руб.);

PTV1 – стоимость Активов Учредителя управления на дату первого ввода активов (руб.) в случае, если на начало инвестиционного горизонта стоимость Активов Учредителя управления равна нулю или – стоимость Активов Учредителя управления на дату начала инвестиционного горизонта (руб.) в случае, если на начало инвестиционного горизонта стоимость Активов Учредителя управления больше нуля (руб.);

ДС_{вывод} – оценочная стоимость имущества, выведенного из доверительного управления в течение расчетного периода;

ДС_{ввод} – оценочная стоимость имущества, переданного в доверительное управление в течение расчетного периода.

$$PTV = \frac{T_1 * PTV1 + T_2 * (PTV1 + ДС^1_{\text{вывод}} - ДС^1_{\text{ввод}}) + T_3 * (PTV1 + \sum_{i=1}^2 ДС^i_{\text{вывод}} - \sum_{i=1}^2 ДС^i_{\text{ввод}}) + \dots + T_n * (PTV1 + \sum_{i=1}^{n-1} ДС^i_{\text{вывод}} - \sum_{i=1}^{n-1} ДС^i_{\text{ввод}})}{\sum_{i=2}^n T_i}$$

где: $T_1, T_2, T_3, \dots, T_n$ – количество дней в подпериоде;

Подпериод начинается с начала отчетного периода либо с даты ввода/вывода активов, в зависимости от того, что наступит позже, и продолжается до следующей даты ввода/вывода активов либо до конца отчетного периода, в зависимости от того, что наступит раньше.

$\sum T_i$ – суммарное количество дней на рассматриваемом временном отрезке

6. Доверительный управляющий раскрывает настоящую Методику на своем официальном сайте в сети «Интернет» по адресу: www.taif-invest.ru.

7. Настоящая Методика, а также вносимые изменения в нее, вступают в силу не позднее 10 (десяти) календарных дней с даты их раскрытия на официальном сайте Доверительного управляющего в сети «Интернет».

8. Расчет Фактического риска производится в валюте, указанной в Инвестиционном профиле Учредителя управления.

9. В случае если по результатам проверки Доверительным управляющим установлено, что Фактический риск Клиента стал превышать Допустимый риск, определенный в его Инвестиционном профиле, Доверительный управляющий осуществляет действия, предусмотренные Методикой определения инвестиционного профиля Учредителя управления ООО «ТАИФ-ИНВЕСТ».