



Утверждаю  
Директор ООО «ТАИФ-ИНВЕСТ»

Т.Н. Замов  
(Приказ №34/1 от 03.05.2018)

## 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 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 в срок не реже 1 раза в квартал по каждому отдельному договору доверительного управления Учредителя управления.

Фактический риск Учредителя управления рассчитывается в следующем порядке:

$$R = 100\% - (PTV2/PTV1) * 100\%,$$

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

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

PTV1–стоимость Активов Учредителя Управления на дату начала инвестиционного горизонта (руб.).

6. Управляющий раскрывает настоящую Методику на своем официальном сайте в информационно-телекоммуникационной сети "Интернет" по адресу: [www.taif-invest.ru](http://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 информационно-телекоммуникационной 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».