



«ПРИНЯТО»
Решением единственного участника
№ ДВ/9-1 от «20» января 2022 г.

Вступает в силу с «24» января 2022 г.

ПОРЯДОК
определения риска (фактического риска) клиента
ООО ИК «Прайвет Капитал»

г. Москва.
2022 г.

1. Настоящий Порядок определения риска (фактического риска) клиента (далее - «Порядок») ООО ИК «Прайвет Капитал» разработан в соответствии с Положением Банка России от 03.08.2015 г. № 482-П «О единых требованиях к правилам осуществления деятельности по управлению ценными бумагами, к порядку раскрытия управляющим информации, а также требованиях, направленных на исключение конфликта интересов управляющего» (далее - «Положение») и иными нормативными правовыми актами Российской Федерации, стандартами профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг и описывает порядок определения риска (фактического риска) Клиента, заключающего с ООО ИК «Прайвет Капитал» (далее – «Управляющий») договор доверительного управления.

2. Термины, используемые в настоящей Порядке, используются в значениях, которое придается Порядком определения инвестиционного профиля, являющимся внутренним документом ООО ИК «Прайвет Капитал», и раскрытым на сайте ООО ИК «Прайвет Капитал» в сети Интернет, договором доверительного управления ценными бумагами, заключенным клиентом с ООО ИК «Прайвет Капитал», в значении, придаваемом обычаем делового оборота в области рынка ценных бумаг, а при отсутствии в указанных документах определений таких терминов – в значении, придаваемом таким терминам действующими нормативными правовыми актами Российской Федерации.

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

4. Размер фактического риска не должен превышать уровень допустимого риска, соответствующего инвестиционному профилю клиента.

5. Управляющий определяет риск (фактический риск) клиента, не являющегося квалифицированным инвестором, при осуществлении доверительного управления активами клиента.

6. Управляющий определяет риск (фактический риск) клиента по всем договорам доверительного управления (стратегиям) клиента совокупно.

7. Управляющий определяет риск (фактический риск) клиента не реже одного раза в месяц, по состоянию на последний рабочий день, для своевременного выявления несоответствие фактического риска допустимому риску, определенному в присвоенном клиенту инвестиционном профиле.

8. Управляющий определяет риск (фактический риск) Клиента в соответствии со следующей методикой:

Снижение (в процентах) стоимости имущества на конец расчетного периода по отношению к стоимости имущества на начало расчетного периода, скорректированное с учетом стоимости переданного в управление и выведенного из управления имущества в течение расчетного периода:

$$P = (FRu / CIn) * 100, \text{ где}$$

P – риск (фактический риск) Клиента;

CIn – оценочная стоимость имущества Клиента на начало расчетного периода;

FRu – убыток от доверительного управления за расчетный период;

$$FR = CИк - CИп + ДСвывод - ДСсвод, \text{ где}$$

FR – финансовый результат (доход/убыток) от доверительного управления;

CИк - оценочная стоимость имущества Клиента на конец расчетного периода;

ДСвывод – оценочная стоимость имущества, выведенного из управления в течение расчетного периода;

ДСсвод – оценочная стоимость имущества, переданного в управление течение расчетного периода.

Расчетный период – период с даты начала инвестиционного горизонта по день окончания соответствующего календарного месяца.

9. Риск (фактический риск) рассчитывается как относительная величина в процентах к стоимости имущества Клиента, находящегося в доверительном управлении.

10. Управляющий вправе вносить изменения в настоящий Порядок.