

УТВЕРЖДЕН
Решением **Общего** собрания
участников Общества с ограниченной
ответственностью **Управляющая**
компания «Эвокорп»

Протокол № 22 от «16» мая 2018 г.

**Порядок определения Обществом с ограниченной ответственностью
Управляющая компания «Эвокорп» инвестиционного профиля клиента и
перечень сведений, необходимый для его определения
(новая редакция)
(вступает в силу с 28 мая 2018 года)**

**г. Москва
2018**

1. ОБЩИЕ ПОЛОЖЕНИЯ

1.1. Настоящий Порядок определения инвестиционного профиля Клиента и перечень сведений, необходимый для его определения (далее по тексту - Порядок) 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), «Базовым стандартом совершения управляющим операций на финансовом рынке», утвержденными Банком России 16.11.2017 г. (далее - Базовый стандарт), иными нормативными актами Российской Федерации.

1.2. Основные термины и определения:

Управляющий – Общество с ограниченной ответственностью Управляющая компания «Эвокорп».

Договор – Договор доверительного управления ценными бумагами.

Клиент – юридическое или физическое лицо, намеренное заключить или заключившее с Управляющим договор доверительного управления;

Инвестиционный профиль Клиента – инвестиционные цели Клиента на определенный период времени и риск возможных убытков, связанных с доверительным управлением ценными бумагами и денежными средствами, который Клиент способен нести за тот же период времени.

Инвестиционный горизонт – период времени, за который определяются ожидаемая доходность и допустимый риск для Клиента.

Ожидаемая доходность – доходность от доверительного управления, на которую рассчитывает Клиент на инвестиционном горизонте.

Допустимый риск – величина допустимых убытков за определенный период времени в абсолютном или относительном выражении, которые способен нести Клиент, если он не является квалифицированным инвестором.

Фактический риск - величина убытков в абсолютном или относительном выражении, который несет Клиент за определенный период времени (включает в себя риск убытков, в том числе риск изменения стоимости активов).

2. ИНВЕСТИЦИОННЫЙ ПРОФИЛЬ КЛИЕНТА

2.1. Управляющий обязан определить Инвестиционный профиль Клиента до начала осуществления доверительного управления ценными бумагами, принять все зависящие от него разумные меры для обеспечения соответствия доверительного управления инвестиционному профилю Клиента, а также обязан проинформировать Клиента о рисках, предоставления Клиентом недостоверной информации для определения его инвестиционного профиля, а также о рисках, связанных с осуществлением операция на рынке ценных бумаг, в соответствии с требованиями нормативных актов Банка России и внутренних документов Управляющего.

2.2. Инвестиционный профиль Клиента может определяться Управляющим на основании одного из следующих принципов:

1) инвестиционный профиль определяется по каждому договору доверительного управления, заключенному с Клиентом;

2) инвестиционный профиль определяется по каждому Клиенту вне зависимости от количества договоров доверительного управления, заключенных с ним;

2.3. Если инвестиционный профиль Клиента определен в соответствии с подп. 2 п.2.2. настоящего Порядка, Управляющий при наличии утвержденных стандартных стратегий управления вправе предлагать их Клиенту при условии, что стандартный инвестиционный профиль такой стратегии соответствует инвестиционному профилю Клиента.

2.4. Инвестиционный профиль Клиента, не являющегося квалифицированным инвестором, определяется как:

1) инвестиционный горизонт;

2) ожидаемая доходность;

3) допустимый риск.

2.5. При определении Инвестиционного профиля Клиента, не являющего квалифицированным инвестором, с целью расчета Допустимого риска, Управляющий также может собрать (установить) следующие сведения о Клиенте:

2.5.1. Для физических лиц, в том числе физических лиц, являющихся индивидуальными предпринимателями:

1) предполагаемые цели и сроки инвестирования;

2) возраст физического лица;
3) примерные среднемесячные доходы и примерные среднемесячные расходы физического лица за последние 12 месяцев;

- 4) сведения о сбережениях физического лица;
5) сведения об опыте и знаниях физического лица в области инвестирования.

2.5.2. Для юридических лиц, являющихся коммерческой организацией:

1) предполагаемые цель и сроки инвестирования;
2) соотношение чистых активов Клиента к объему средств, передаваемых в доверительное управление;

3) информацию о квалификации специалистов казначейства или иного подразделения, отвечающего за инвестиционную деятельность в юридическом лице;

4) количество и объем операций с различными финансовыми инструментами за последний отчетный год;

5) иные сведения, необходимые Управляющему для определения Инвестиционного профиля Клиента.

2.5.3. Для юридических лиц, являющихся некоммерческой организацией:

1) предполагаемые цель и сроки инвестирования, дополнительные условия и ограничения, которые необходимо будет учитывать при доверительном управлении (при наличии);

2) наличие специалистов или подразделения, отвечающих за инвестиционную деятельность в юридическом лице;

3) наличие операций с различными финансовыми инструментами за последний отчетный год;

4) размер (объем) активов, планируемых к передаче в доверительное управление, а также периодичность их передачи в доверительное управление.

5) иные сведения, необходимые Управляющему для определения Инвестиционного профиля Клиента.

2.6. При определении Инвестиционного профиля Клиента, являющегося квалифицированным инвестором в силу закона или признанного таковым Управляющим, Управляющему необходимо собрать (установить) следующую информацию:

- предполагаемый срок инвестирования;
- инвестиционный горизонт;
- ожидаемую доходность.

2.7. Определяя Инвестиционный профиль Клиента, Управляющий принимает во внимание, что, не проявив должную заботливость об интересах Клиента, который выражается в его Инвестиционном профиле, он несет ответственность в соответствии со статьей 1022 ГК РФ. В этой связи определение Инвестиционного профиля является определением интереса Клиента, который в дальнейшем должен определять действия Управляющего, связанные с управлением имуществом Клиента.

2.8. В случае определения инвестиционного профиля Клиента Управляющим на основании принципа, предусмотренного в подп. 2 п. 2.2. настоящего Порядка Управляющий предусматривает стандартный инвестиционный профиль. При этом единые правила и принципы формирования состава и структуры стандартных стратегий не подразумевают идентичный состав и структуру активов для каждого Клиента в рамках стратегии.

2.9. Критерии и порядок отнесения инвестиционной стратегии к стандартной является объектом совместного решения Начальника отдела управления активами и сотрудника, ответственного за организацию системы управления рисками Управляющего.

2.10. Согласованный список стандартных инвестиционных стратегий и включение стратегий в этот список утверждается приказом Генерального директора Управляющего.

2.11. Критериями отнесения инвестиционной стратегии к стандартной являются следующие возможные факторы (включая, но не ограничиваясь):

- фактический PnL каждого Клиента существенно не отклонялся от среднего PnL, раскрываемого по стандартной стратегии;
- условия обращения инструментов, входящих в стратегию, похожи или совпадают;
- количество сделок в течение года не превышает определенное количество;
- инвестиционная идея стратегии и/или кредитное качество приобретаемых инструментов похожи или совпадает.

2.12. Стандартный инвестиционный профиль Клиента определяется по каждой стандартной инвестиционной стратегии управления.

2.13. Доверительное управление денежными средствами и/или ценными бумагами Клиента возможно только в случае получения согласия Клиента с определенным для него Инвестиционным профилем и/или стандартным инвестиционным профилем, за исключением случаев, установленных Положением.

2.14. Инвестиционный профиль предоставляется Клиенту путем направления его по адресу электронной почты, указанной Клиентом в анкете, являющейся приложением к Договору. Инвестиционный профиль, направленный по электронной почте, считается представленным Клиенту с момента его направления Управляющим по электронной почте, указанной в анкете Клиента. Если Клиент в Договоре выбрал другой способ получения уведомлений, Управляющий направляет Инвестиционный профиль Клиенту тем способом, который выбрал Клиент.

2.15. При наличии несогласия Клиента с присвоенным ему индивидуальным инвестиционным профилем Клиент в течение 5 (Пяти) рабочих дней после получения Инвестиционного профиля обязан сообщить о них Управляющему. Стороны обязаны предпринять все необходимые действия для разрешения возникших противоречий. В случае отсутствия возражений в указанный срок Управляющий считает, что согласие Клиента с Инвестиционным профилем получено.

2.16. Если Клиент не согласен с Инвестиционным профилем, присвоенным Управляющим, возможен пересмотр Допустимого риска в сторону снижения, при одновременном пересмотре Ожидаемой доходности.

3. ОПРЕДЕЛЕНИЕ ИНВЕСТИЦИОННОГО ГОРИЗОНТА

3.1. Инвестиционный горизонт определяется Клиентом исходя из периода времени, за который он хочет достичь Ожидаемую доходность при Допустимом риске.

3.2. Инвестиционный горизонт не может превышать срок, на который заключается Договор.

3.3. В случае, если срок договора доверительного управления превышает Инвестиционный горизонт, определенный в Инвестиционном профиле Клиента, Управляющий обязан определять ожидаемую доходность и допустимый риск за каждый Инвестиционный горизонт, входящий в срок Договора.

4. ОПРЕДЕЛЕНИЕ ОЖИДАЕМОЙ ДОХОДНОСТИ

4.1. Ожидаемая доходность Клиента, указываемая им при определении Инвестиционного профиля, не накладывает на Управляющего обязанности по ее достижению и не является гарантией для Клиента.

4.2. Управляющий при осуществлении доверительного управления обязан предпринять все зависящие от него действия для достижения Ожидаемой доходности при принятии риска в диапазоне Допустимого риска.

5. ПОРЯДОК ОПРЕДЕЛЕНИЯ РИСКА

5.1. Порядок и методика определения Допустимого и Фактического риска Клиента и периодичность контроля риска Клиента устанавливается в Приложении № 6 и Приложении № 7 настоящего Порядка.

5.2. Допустимый и Фактический риск может быть выражен в виде абсолютной величины и/или в виде относительной величины.

5.3. При определении Допустимого риска Клиента Управляющий учитывает требования нормативных актов о недопустимости его превышения в рамках доверительного управления.

5.4. Фактический риск Клиента рассчитывается Управляющим по каждому отдельному Договору Клиента. При этом Фактический риск Клиента, рассчитываемый Управляющим, не должен превышать Допустимый риск, определенный в Инвестиционном профиле Клиента.

5.5. Если доверительное управление активами Клиента осуществляется согласно стандартной стратегии управления, Фактический риск Клиента рассчитывается Управляющим по общему портфелю данной стандартной стратегии управления, в который входят активы всех Клиентов Управляющего, которые управляются согласно данной стратегии.

5.6. Если Клиент не согласен с Допустимым риском, рассчитанным Управляющим, возможен пересмотр Допустимого риска в сторону снижения, при одновременном пересмотре Ожидаемой доходности.

6. ПОРЯДОК ИЗМЕНЕНИЯ ИНВЕСТИЦИОННОГО ПРОФИЛЯ

6.1. Управляющий вправе изменить или пересмотреть Инвестиционный профиль с согласия Клиента.

6.2. Основанием для изменения Инвестиционного профиля Управляющим могут служить следующие события (включая, но не ограничиваясь):

- 1) Изменение стандартной инвестиционной стратегии управления по желанию Клиента;
 - 2) Внесение изменений в состав или структуру модельного портфеля стратегии по инициативе Управляющего;
 - 3) Изменение рыночных условий, вынуждающих Управляющего изменить Инвестиционный горизонт, Ожидаемую доходность или Допустимый риск стратегии.
- 6.3. Основанием пересмотра Инвестиционного профиля Клиента является:
- 1) изменение сведений о Клиенте, предусмотренных пунктами 2.5 и 2.6 настоящего Порядка;
 - 2) изменение экономической ситуации в Российской Федерации, в том числе изменение ключевой ставки Банка России;
 - 3) внесение изменений в законодательство Российской Федерации, в том числе нормативные акты Банка России;
 - 4) внесение изменений в Базовый стандарт;
 - 5) внесение изменений во внутренний стандарт (стандарты) саморегулируемой организации, членом которой является Управляющий (при наличии).
- 6.4. Основаниями пересмотра стандартного инвестиционного профиля Клиента являются:
- 1) изменение экономической ситуации в Российской Федерации, в том числе изменение ключевой ставки Банка России;
 - 2) внесение изменений в законодательство Российской Федерации, в том числе нормативные акты Банка России;
 - 3) внесение изменений в Базовый стандарт;
 - 4) внесение изменений во внутренний стандарт (стандарты) саморегулируемой организации, членом которой является Управляющий (при наличии).
- 6.5. Порядок получения согласия Клиента с измененным Инвестиционным профилем осуществляется в соответствии с п. 2.14 и п. 2.15 Порядка.
- 6.6. Управляющий обязан привести портфель Клиента в соответствии с измененным Инвестиционным профилем Клиента в течение 1 (Одного) месяца.

Приложение № 1
к Порядку определения Обществом с
ограниченной ответственностью
Управляющая компания «Эвокорп»
инвестиционного профиля клиента и
перечень сведений, необходимый для его
определения

Анкета для определения инвестиционного профиля физического лица – квалифицированного инвестора

Дата составления _____		Коэффициент
Ф.И.О. клиента		
ИНН клиента (при наличии)		
Данные документа, удостоверяющего личность физического лица		
Тип инвестора	<input type="checkbox"/> квалифицированный инвестор	
Тип клиента	<input type="checkbox"/> физическое лицо	
Срок инвестирования		
Инвестиционный горизонт	<input type="checkbox"/> 1 год <input type="checkbox"/> 2 года <input type="checkbox"/> 3 года <input type="checkbox"/> Иное _____	
Ожидаемая доходность инвестирования, по окончании инвестиционного горизонта	Размер ожидаемой доходности: <input type="checkbox"/> должна быть выше суммы первоначальных инвестиций, без учета налогов и вознаграждения УК (без учета риска дефолта контрагента/эмитента) <input type="checkbox"/> должна быть равна сумме первоначальных инвестиций, без учета налогов и вознаграждения УК (без учета риска дефолта контрагента/эмитента) <input type="checkbox"/> может быть ниже суммы первоначальных инвестиций, без учета налогов и вознаграждения УК (без учета риска дефолта контрагента/эмитента) Получение дохода: <input type="checkbox"/> разовый доход <input type="checkbox"/> периодичный доход Заинтересованность в получении дохода: <input type="checkbox"/> в краткосрочной перспективе <input type="checkbox"/> в среднесрочной перспективе <input type="checkbox"/> в долгосрочной перспективе	

Управляющий не гарантирует достижения ожидаемой доходности, определенной в инвестиционном профиле и (или) в стандартном инвестиционном профиле Клиента.

Приложение № 2
к Порядку определения Обществом с
ограниченной ответственностью
Управляющая компания «Эвокорп»
инвестиционного профиля клиента и
перечень сведений, необходимый для его
определения

Анкета для определения инвестиционного профиля физического лица, не являющегося квалифицированным инвестором, в том числе для физического лица, являющегося индивидуальным предпринимателем, не являющегося квалифицированным инвестором

Дата составления _____		Коэффициент
Ф.И.О. клиента		
ИНН клиента (при наличии)		
Данные документа, удостоверяющего личность физического лица		
Тип инвестора	<input type="checkbox"/> неквалифицированный инвестор	
Тип клиента	<input type="checkbox"/> физическое лицо	
Предполагаемые цели инвестирования		
Предполагаемые сроки инвестирования		
Возраст	<input type="checkbox"/> до 20 лет	0,1
	<input type="checkbox"/> от 20 до 50	0,3
	<input type="checkbox"/> старше 50	0,1
Примерные среднемесячные доходы и среднемесячные расходы за последние 12 месяцев	<input type="checkbox"/> среднемесячные доходы за вычетом среднемесячных расходов больше нуля	0,2
	<input type="checkbox"/> среднемесячные доходы за вычетом среднемесячных расходов меньше нуля	0
Информация о сбережениях	<input type="checkbox"/> сбережения превышают стоимость активов, передаваемых в доверительное управление	0,2
	<input type="checkbox"/> сбережения не превышают стоимость активов, передаваемых в доверительное управление	0
Опыт и знания в области инвестирования	<input type="checkbox"/> отсутствует	0

	<input type="checkbox"/> до 1 года <input type="checkbox"/> от 1 года до 3 лет <input type="checkbox"/> от 3 лет	0,1 0,2 0,3
<i>Итоговый коэффициент</i>		
Инвестиционный горизонт	<input type="checkbox"/> 1 год <input type="checkbox"/> 2 года <input type="checkbox"/> 3 года <input type="checkbox"/> Иное _____	
Ожидаемая доходность инвестирования, по окончании инвестиционного горизонта	Размер ожидаемой доходности: <input type="checkbox"/> должна быть выше суммы первоначальных инвестиций, без учета налогов и вознаграждения УК (без учета риска дефолта контрагента/эмитента) <input type="checkbox"/> должна быть равна сумме первоначальных инвестиций, без учета налогов и вознаграждения УК (без учета риска дефолта контрагента/эмитента) <input type="checkbox"/> может быть ниже суммы первоначальных инвестиций, без учета налогов и вознаграждения УК (без учета риска дефолта контрагента/эмитента) Получение дохода: <input type="checkbox"/> разовый доход <input type="checkbox"/> периодичный доход Заинтересованность в получении дохода: <input type="checkbox"/> в краткосрочной перспективе <input type="checkbox"/> в среднесрочной перспективе <input type="checkbox"/> в долгосрочной перспективе	
Допустимый риск	Размер итогового коэффициента /графа заполняется Управляющим/	

Управляющий не гарантирует достижения ожидаемой доходности, определенной в инвестиционном профиле и (или) в стандартном инвестиционном профиле Клиента.

Приложение № 3
к Порядку определения Обществом с
ограниченной ответственностью
Управляющая компания «Эвокорп»
инвестиционного профиля клиента и
перечень сведений, необходимый для его
определения

**Пример Анкеты для определения инвестиционного профиля юридического лица-
квалифицированного инвестора**

Дата составления _____		Коэффициент
Полное наименование (Ф.И.О.) клиента		
ИНН клиента		
ОГРН юридического лица		
Тип инвестора	<input type="checkbox"/> квалифицированный инвестор	
Тип клиента	<input type="checkbox"/> юридическое лицо	
Срок инвестирования		
Инвестиционный горизонт	<input type="checkbox"/> 1 год <input type="checkbox"/> 2 года <input type="checkbox"/> 3 года <input type="checkbox"/> Иное _____	
Ожидаемая доходность инвестирования, по окончании инвестиционного горизонта	Размер ожидаемой доходности: <input type="checkbox"/> должна быть выше суммы первоначальных инвестиций, без учета налогов и вознаграждения УК (без учета риска дефолта контрагента/эмитента) <input type="checkbox"/> должна быть равна сумме первоначальных инвестиций, без учета налогов и вознаграждения УК (без учета риска дефолта контрагента/эмитента) <input type="checkbox"/> может быть ниже суммы первоначальных инвестиций, без учета налогов и вознаграждения УК (без учета риска дефолта контрагента/эмитента) Получение дохода: <input type="checkbox"/> разовый доход <input type="checkbox"/> периодичный доход Заинтересованность в получении дохода: <input type="checkbox"/> в краткосрочной перспективе <input type="checkbox"/> в среднесрочной перспективе <input type="checkbox"/> в долгосрочной перспективе	

Управляющий не гарантирует достижения ожидаемой доходности, определенной в инвестиционном профиле и (или) в стандартном инвестиционном профиле Клиента.

Приложение № 4
к Порядку определения Обществом с
ограниченной ответственностью
Управляющая компания «Эвокорп»
инвестиционного профиля клиента и
перечень сведений, необходимый для его
определения

**Пример Анкеты для определения инвестиционного профиля юридического лица, являющегося
 коммерческой организацией, не являющегося квалифицированным инвестором**

Дата составления _____		Коэффициент
Полное наименование клиента		
ИНН клиента		
ОГРН юридического лица		
Тип инвестора	<input type="checkbox"/> квалифицированный инвестор <input type="checkbox"/> неквалифицированный инвестор	
Тип клиента	<input type="checkbox"/> юридическое лицо	
Предполагаемые цели инвестирования		
Предполагаемые сроки инвестирования		
Соотношение чистых активов к объему средств передаваемых в доверительное управление	<input type="checkbox"/> больше 0 <input type="checkbox"/> меньше 0	0,3 0
Квалификация специалистов подразделения, отвечающего за инвестиционную деятельность	<input type="checkbox"/> отсутствует	0
	<input type="checkbox"/> высшее экономическое/финансовое образование	0,1
	<input type="checkbox"/> высшее экономическое/финансовое образование и опыт работы на финансовом рынке более 1 года	0,2
Количество и объем операций с различными финансовыми инструментами за последний отчетный год	<input type="checkbox"/> операции не осуществлялись	0
		0,2

	<input type="checkbox"/> менее 10 операций совокупной стоимостью менее 10 миллионов рублей <input type="checkbox"/> более 10 операций совокупной стоимостью более 10 миллионов рублей	0,4
<i>Итоговый коэффициент</i>		
Инвестиционный горизонт	<input type="checkbox"/> 1 год <input type="checkbox"/> 2 года <input type="checkbox"/> 3 года <input type="checkbox"/> Иное _____	
Ожидаемая доходность инвестирования, по окончании инвестиционного горизонта	<p>Размер ожидаемой доходности:</p> <input type="checkbox"/> должна быть выше суммы первоначальных инвестиций, без учета налогов и вознаграждения УК (без учета риска дефолта контрагента/эмитента) <input type="checkbox"/> должна быть равна сумме первоначальных инвестиций, без учета налогов и вознаграждения УК (без учета риска дефолта контрагента/эмитента) <input type="checkbox"/> может быть ниже суммы первоначальных инвестиций, без учета налогов и вознаграждения УК (без учета риска дефолта контрагента/эмитента) Получение дохода: <input type="checkbox"/> разовый доход <input type="checkbox"/> периодичный доход Заинтересованность в получении дохода: <input type="checkbox"/> в краткосрочной перспективе <input type="checkbox"/> в среднесрочной перспективе <input type="checkbox"/> в долгосрочной перспективе	
Допустимый риск	Размер итогового коэффициента /графа заполняется Управляющим/	

Управляющий не гарантирует достижения ожидаемой доходности, определенной в инвестиционном профиле и (или) в стандартном инвестиционном профиле Клиента.

Приложение № 5
к Порядку определения Обществом с
ограниченной ответственностью
Управляющая компания «Эвокорп»
инвестиционного профиля клиента и
перечень сведений, необходимый для его
определения

Пример Анкеты для определения инвестиционного профиля юридического лица, являющегося некоммерческой организацией, не являющегося квалифицированным инвестором

Дата составления _____		Коэффициент
Полное наименование клиента		
ИНН клиента		
ОГРН юридического лица		
Тип инвестора	<input type="checkbox"/> квалифицированный инвестор <input type="checkbox"/> неквалифицированный инвестор	
Тип клиента	<input type="checkbox"/> юридическое лицо	
Предполагаемые цели инвестирования		
Предполагаемые сроки инвестирования		
Дополнительные условия и ограничения, которые необходимо будет учитывать при доверительном управлении (при наличии)		
Наличие специалистов или подразделения, отвечающих за инвестиционную деятельность в юридическом лице;	<input type="checkbox"/> отсутствует	0
	<input type="checkbox"/> высшее экономическое/финансовое образование	0,1
	<input type="checkbox"/> высшее экономическое/финансовое образование и опыт работы на финансовом рынке более 1 года	0,2
	<input type="checkbox"/> высшее экономическое/финансовое образование и опыт работы на финансовом рынке более 1 года в должности, напрямую связанной с инвестированием активов	0,3
Количество и объем операций с различными финансовыми	<input type="checkbox"/> операции не осуществлялись	0

инструментами за последний отчетный год	<input type="checkbox"/> менее 10 операций совокупной стоимостью менее 10 миллионов рублей	0,2
	<input type="checkbox"/> более 10 операций совокупной стоимостью более 10 миллионов рублей	0,4
Размер (объем) активов, планируемых к передаче в доверительное управление, а также периодичность их передачи в доверительное управление.		
<i>Итоговый коэффициент</i>		
Инвестиционный горизонт	<input type="checkbox"/> 1 год <input type="checkbox"/> 2 года <input type="checkbox"/> 3 года <input type="checkbox"/> Иное _____	
Ожидаемая доходность инвестирования, по окончании инвестиционного горизонта	<p>Размер ожидаемой доходности:</p> <input type="checkbox"/> должна быть выше суммы первоначальных инвестиций, без учета налогов и вознаграждения УК (без учета риска дефолта контрагента/эмитента) <input type="checkbox"/> должна быть равна сумме первоначальных инвестиций, без учета налогов и вознаграждения УК (без учета риска дефолта контрагента/эмитента) <input type="checkbox"/> может быть ниже суммы первоначальных инвестиций, без учета налогов и вознаграждения УК (без учета риска дефолта контрагента/эмитента) Получение дохода: <input type="checkbox"/> разовый доход <input type="checkbox"/> периодичный доход Заинтересованность в получении дохода: <input type="checkbox"/> в краткосрочной перспективе <input type="checkbox"/> в среднесрочной перспективе <input type="checkbox"/> в долгосрочной перспективе	
Допустимый риск	Размер итогового коэффициента /графа заполняется Управляющим/	

Управляющий не гарантирует достижения ожидаемой доходности, определенной в инвестиционном профиле и (или) в стандартном инвестиционном профиле Клиента.

Приложение № 6
к Порядку определения Обществом с
ограниченной ответственностью
Управляющая компания «Эвокорп»
инвестиционного профиля клиента и
перечень сведений, необходимый для его
определения

Методика определения Допустимого риска Клиента и периодичность контроля риска Клиента

1. Порядок определения Допустимого риска Клиента

1.1. Допустимый риск инвестиционного портфеля клиента, не являющегося квалифицированным инвестором, за инвестиционный горизонт с вероятностью 95 процентов должен составлять не более 20 процентов стоимости указанного инвестиционного портфеля, определенной по состоянию на начало этого инвестиционного горизонта.

1.2. Допустимый риск Клиента, являющегося квалифицированным инвестором, не определяется Управляющим.

1.3. Допустимый риск Клиента, управление инвестиционным портфелем которого осуществляется по индивидуальной инвестиционной стратегии, не относящейся к стандартной, определяется Управляющим, исходя из сведений, предоставленных в Анкете-опроснике (Приложения № 2; 4; 5 к Порядку).

В таблице представлены коэффициенты уровня риска активов, которые могут приобретаться Управляющим для Клиента в зависимости от Допустимого риска, определенного в индивидуальном Инвестиционном профиле Клиента.

К консервативным относятся активы с коэффициентом – от 0,1 до 0,4

К умеренно агрессивным относятся активы с коэффициентом – от 0,5 до 0,7

К агрессивным относятся активы с коэффициентом – от 0,7 до 1.

В консервативном портфеле Клиента доля консервативных инструментов не должна быть ниже 80% от активов.

В умеренно агрессивном портфеле Клиента доля консервативных инструментов не должна быть ниже 50%.

В агрессивном портфеле Клиента доля консервативных инструментов не установлена.

Коэффициент	Актив
0,1	Денежные средства на счетах и во вкладах в кредитных организациях с рейтингом не ниже суверенного, сниженного на 3 ступени
0,2	Облигации/еврооблигации либо эмитенты облигаций, имеющие рейтинг не ниже суверенного, сниженного на три ступени и сроком до погашения (оферты) до 2 лет Инвестиционные паи открытых паевых инвестиционных фондов
0,3	Облигации, еврооблигации либо эмитенты облигаций, имеющие рейтинг не ниже суверенного, сниженного на три ступени и сроком до погашения (оферты) свыше 2 лет Акции российских эмитентов, входящих в первый уровень котировального списка Московской биржи
0,4	Иные облигации, допущенные к организованным торгам
0,5	Иные облигации Депозитарные расписки Инвестиционные паи интервальных паевых инвестиционных фондов
0,6	Акции российских эмитентов, за исключением акций, включенных в первый уровень котировального списка Московской Биржи
0,7	Инвестиционные паи закрытых паевых инвестиционных фондов
0,8	Иные акции

0,9	Ипотечные сертификаты участия
1	Производные финансовые инструменты

2. Периодичность контроля Допустимого риска Клиента

2.1. Контроль за Допустимым риском Клиента осуществляется сотрудником, ответственным за организацию системы управления рисками Управляющего.

2.2. Контроль за Допустимым риском Клиента осуществляется с периодичностью 1 раз в календарный месяц по состоянию на последний календарный день.

2.3. В случае если показатель Допустимого риска в течение трех периодов превышает установленный уровень, прописанный в стандартном Инвестиционном профиле клиента, не являющегося квалифицированным инвестором, Управляющий пересматривает состав портфеля.

2.4. Если пересмотр состава портфеля для индивидуальных стратегий противоречит инвестиционной идеи самой стратегии, возможен пересмотр инвестиционного профиля с изменением уровня допустимого риска согласно п. 5.6. Порядка.

Приложение № 7
к Порядку определения Обществом с
ограниченной ответственностью
Управляющая компания «Эвокорп»
инвестиционного профиля клиента и
перечень сведений, необходимый для его
определения

Методика определения Фактического риска Клиента и периодичность контроля риска Клиента

1. Настоящая Методика определения Фактического риска клиента (далее - Методика) разработан в соответствии с требованиями, установленными законодательством Российской Федерации.
2. Размер Фактического риска определяется на основе долей финансовых инструментов и коэффициентов риска, соответствующих активам, по следующей формуле:

N

$$R = \sum_{i=1}^N w_i \times k_i, \text{ где}$$

N - количество типов финансовых инструментов в активах клиента;

w_i - доля определенного типа финансовых инструментов в активах клиента;

k_i - коэффициент риска определенного типа финансового инструмента из соответствующей Группы риска, указанного в Таблице №1 настоящей Методики.

Коэффициент риска не является процентом или размером убытка. Через коэффициент риска определяется удельный вес инструментов определенной Группы риска в активах клиента в зависимости от предельного значения уровня риска, соответствующего инвестиционному профилю.

Таблица №1

№ Группы риска	Коэффициент риска (k)	Наименование финансового инструмента/актива
1	0.1	Денежные средства на счетах и во вкладах в кредитных организациях с рейтингом не ниже суверенного, сниженного на 3 ступени
		Облигации/еврооблигации либо эмитенты облигаций, имеющие рейтинг не ниже суверенного, сниженного на три ступени и сроком до погашения (оферты) до 2 лет Инвестиционные паи открытых паевых инвестиционных фондов
		Облигации, еврооблигации либо эмитенты облигаций, имеющие рейтинг не ниже суверенного, сниженного на три ступени и сроком до погашения (оферты) свыше 2 лет Акции российских эмитентов, входящих в первый уровень котировального списка Московской биржи
		Иные облигации, допущенные к организованным торгам
2	0.5	Иные облигации российских эмитентов, не вошедшие в Группу риска №1 и не находящиеся в состоянии дефолта, за исключением субординированных и конвертируемых
		Инвестиционные паи интервальных паевых инвестиционных фондов
		Депозитарные расписки
		Акции российских эмитентов, за исключением акций, включенных в первый уровень котировального списка Московской Биржи
		Инвестиционные паи закрытых паевых инвестиционных фондов
3	1	Иные акции российских эмитентов, не вошедшие в Группу риска №2

	Иностранные акции
	Иностранные облигации
	Ипотечные сертификаты участия
	Производные финансовые инструменты
	Иные финансовые инструменты, не вошедшие в Группы риска №1 и №2

3. Управляющий выявляет несоответствия Фактического риска Допустимому риску с периодичностью 1 раз в календарный месяц по состоянию на последний календарный день.
4. Контроль за Фактическим риском Клиента осуществляется сотрудником, ответственным за организацию системы управления рисками Управляющего.
5. Управляющий вправе вносить изменения в настоящую Методику.