

## TIKSLAS

Šiame dokumente pateikiama pagrindinė informacija apie šį investicinį produktą. Tai nėra rinkodaros medžiaga. Pateikti šią informaciją reikalaujama įstatymu, siekiant padėti jums lengviau suprasti šio produkto pobūdį, riziką, sąnaudas, galimą pelną bei nuostolius ir padėti jį palyginti su kitais produktais.

**Jūs ketinate įsigyti produktą, kuris nėra paprastas ir kurį gali būti sudėtinga suprasti.**

## PRODUKTAS

<b>Produkto pavadinimas:</b>	Atvirojo tipo informuotiesiems investuotojams skirto sudėtinio investicinio fondo „ALGORITHMIC TRADING PORTFOLIO“ (toliau – <b>Investicinis fondas</b> ) subfondo „ATP M“ (toliau – <b>Subfondas</b> ) investiciniai vienetai
<b>Teikėjo pavadinimas:</b>	Uždaroji akcinė bendrovė „Orion Asset Management“ (toliau – <b>Valdymo įmonė</b> )
<b>Unikalūs produkto identifikatoriai:</b>	I058
<b>Teikėjo interneto svetainė:</b>	am.orion.lt
<b>Teikėjo telefono numeris:</b>	+370 5 203 2699
<b>Priežiūros institucija:</b>	Lietuvos bankas
<b>PID paruošimo data:</b>	2020 m. birželio 5 d.

## KOKS ŠIS PRODUKTAS?

## RŪŠIS

Subfondas yra atvirojo tipo informuotiesiems investuotojams skirto sudėtinio investicinio fondo subfondas. Investicinis fondas ir jo dalimi esantis Subfondas nėra juridinis asmuo. Subfondas yra Investicinio fondo turto dalis, tvarkoma atskirai nuo kito Investicinio fondo turto. Investicinis fondas įsteigtas pagal Lietuvos Respublikos informuotiesiems investuotojams skirtų kolektyvinio investavimo subjektų įstatymą.

## TIKSLAI

Subfondo turtas investuojamas, siekiant ilguoju laikotarpiu uždirbti teigiamą grąžą, nepriklausomai nuo bendros rinkų krypties ar ekonominio ciklo fazės, naudojant kiek galima didesnį matematinių algoritmų kiekį ir investuojant į skirtingas turto klases bei aktyviai keičiant portfelio sudėtį, siekiant išnaudoti trumpos trukmės rinkos pokyčius. Subfondo lėšos gali būti investuojamos į finansines priemones (ateities sandorius, akcijas ir depozitoriumo pakvitavimus dėl akcijų, kitus vertybinius popierius, suteikiančius teisę įsigyti ar perleisti perleidžiamuosius vertybinius popierius arba išvestines finansines priemones susietas su perleidžiamaisiais vertybiniais popieriais, finansiniais indeksais, palūkanų normomis, valiutomis ar valiutos kursais, pinigų rinkos priemonės, indėlius kredito įstaigose, obligacijas ir kitų formų ne nuosavybės vertybinius popierius, kitas išvestines finansines priemones (įskaitant susitarimus dėl skirtumų (angl. *contracts for differences (CFD)*), kurios yra susietos su prieš tai nurodytomis finansinėmis priemonėmis, finansiniais indeksais, palūkanų normomis, biržos prekėmis, valiutomis ar valiutos kursais, taip pat gali būti investuojama į akcijų, indeksų ir ateities sandorių opcionus, jeigu visomis šiomis finansinėmis priemonėmis prekiaujama reguliuojamose rinkose arba daugiašalėse prekybos sistemose (išskyrus indėlius kredito įstaigose). Subfondo investicijos yra neribojamos geografiniais regionais arba pramonės sektoriais.

Subfondo generuojama investicinė grąža ilguoju laikotarpiu tiesiogiai nekoreliuoja su kainų judėjimu finansų rinkose. Subfondo investicinė grąža priklausys nuo to, kaip Investicinio fondo (Subfondo) valdytojui pavyks sukontroliuoti pagrindines rizikas, būdingas Subfondo valdyme.

**Atkreiptinas dėmesys**, jog Subfondo investicinė grąža nustatoma iš mėnesio pabaigoje apskaičiuotos Subfondo grynujų aktyvų vertės atimant mėnesio pradžios vertę ir padalinant šią sumą iš mėnesio pradžios grynujų aktyvų vertės. Subfondo rizika, vertinant standartinio nuokrypio metodu, yra 7-10 proc., todėl rekomenduojama Subfondo investicinius vienetus išlaikyti ne trumpesnę nei 12 mėnesių periodą.

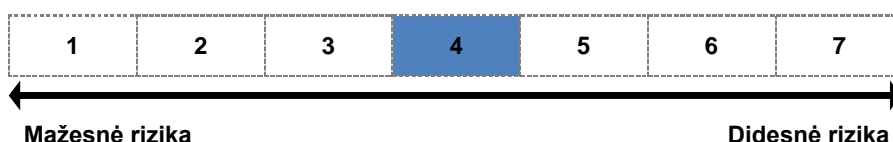
Investicinio fondo (Subfondo) veikla yra neterminuota. Subfondas gali būti panaikintas Valdymo įmonės sprendimu.

## NUMATOMAS NEPROFESIONALUSIS INVESTUOTOJAS

Produktas platinamas tik informuotiesiems investuotojams. Numatomas investuotojas į Subfondą turėtų siekti gauti kapitalo vertės prieaugį iš investicijų į skirtingas turto klases ir finansines priemones bei toleruoti riziką, lemiančią tikimybę prarasti dalį ar visą į Subfondą investuotą sumą. Investuotojai turėtų: (i) turėti žinių apie finansines priemones, kuriomis prekiaujama reguliuojamose rinkose; (ii) suprasti reguliuojamų rinkų veikimo principus; (iii) turėti patirties investuojant į reguliuojamose rinkose.

## KOKIA YRA RIZIKA IR KOKIĄ GRAŽĄ GALĖČIAU GAUTI?

## RIZIKOS RODIKLIS





Nustatant rizikos rodiklį, daroma prielaida, kad Subfondo investiciniai vienetai bus išlaikomi bent 1 metus. Parduodant Subfondo investicinius vienetus neišlaikius jų bent 1 metų, Subfondo rizika gali būti daug didesnė, nei rodo suminis rizikos rodiklis.

Suminis rizikos rodiklis parodo šio produkto rizikos lygį, palyginti su kitais produktais. Jis parodo, kiek tikėtina, kad dėl produkto bus patirta nuostolių dėl pokyčių rinkose arba dėl to, kad negalėsime Jums sumokėti. Šį produktą priskyrėme prie 4 iš 7 rizikos klasių, kur 1 = „mažiausia“ / 2 = „maža“ / 3 = „nedidelė“ / 4 = „vidutinė“ / 5 = „gana didelė“ / 6 = „didelė“ / 7 = „didžiausia“. Tai reiškia, kad Investicinio fondo vertės kitimo rizika yra vidutinio dydžio ir labai tikėtina, kad prastos rinkos sąlygos gali padaryti poveikį Investicinio fondo gebėjimui išpirkti investicinius vienetus.

Šiam produktui nenumatyta jokia apsauga nuo būsimų rinkos veiklos rezultatų, todėl galite netekti dalies arba visos savo investuotos sumos. Tačiau Subfondo nuostolių ribojimo tikslais, jeigu kalendorinio mėnesio eigoje Subfondo grynujų aktyvų vertė nukristų 10 % nuo tą einamąjį kalendorinį mėnesį pasiektos aukščiausios vertės, bus likviduojamas Subfondo portfelis ir sustabdoma algoritminė prekyba likusiam einamojo mėnesio laikotarpiui ir sekančiam kalendoriniam mėnesiui. Aiškumo dėlei pažymima, kad ši sąlyga yra skirta potencialiam viso Subfondo portfelio nuostoliui sustabdyti, tačiau ji negarantuoja, kad absoliučiai visais atvejais susiklostant išskirtinėms situacijoms rinkose, Subfondo mėnesiniai nuostoliai nebus didesni.

**Rinkos rizika.** Egzistuoja neigiamų makroekonominių pokyčių galimybė, galinti turėti įtakos visai finansinių priemonių rinkai, ir rinkos svyravimai gali būti tokie, dėl kurių matematiniais algoritmais paremta prekyba gali turėti ženklų nuostolių.

**Matematiniais algoritmais pagrįsto investavimo rizika.** Egzistuoja rizika, kad istoriniai ir einamieji duomenys, taikomos metodikos, sudarant matematinis algoritmus, nepasikartos, dėl ko matematinų algoritmų modeliai gali neatnešti planuotos investicinės grąžos (Subfondo turto prieaugio).

**Valiutos rizika.** Fondas turi dvi valiutų klases: EUR ir USD. Pasirinkus investuoti užsienio valiuta, **atkreipkite dėmesį į valiutos riziką. Gausite išmokas kita valiuta, tad jūsų galutinė grąža priklausys nuo dviejų valiutų keitimo kurso. Pirmiau nurodytame rodiklyje į šią riziką neatsižvelgta.**

**Atkreiptinas dėmesys,** jog į rizikos rodiklio nustatymą taip pat nėra įtrauktos rizikos, kurios patenka į operacinę riziką, t. y.: Subfondo investavimo sėkmė didele dalimi priklausys ir nuo Valdymo įmonės atsakingų žmonių priimtų investicinių sprendimų bei nuo šių žmonių patirties ir sugebėjimų.

#### VEIKLOS REZULTATŲ SCENARIJAI

Scenarijai	Investicija 10 000 EUR	1 metai	3 metai	5 metai
Nepalankiausias scenarijus	Vidutinė grąža	-38,06%	-9,16%	-6,98%
	Ką galite atgauti atskaičius išlaidas	6194 EUR	7497 EUR	6963 EUR
Nepalankus scenarijus	Vidutinė grąža	-12,15%	-6,33%	-4,70%
	Ką galite atgauti atskaičius išlaidas	8785 EUR	8218 EUR	7862 EUR
Nuosaikus scenarijus	Vidutinė grąža	-1,68%	-1,24%	-0,80%
	Ką galite atgauti atskaičius išlaidas	9832 EUR	9632 EUR	9606 EUR
Palankus scenarijus	Vidutinė grąža	6,00%	4,54%	3,79%
	Ką galite atgauti atskaičius išlaidas	10600 EUR	11426 EUR	12044 EUR

Šioje lentelėje parodyti pinigai, kuriuos galėtumėte atgauti per kitus metus pagal įvairius scenarijus, darant prielaidą, kad investuojate 10 000 EUR. Iš pateiktų scenarijų matyti, kokie galėtų būti jūsų investicijos veiklos rezultatai. Galite juos palyginti su kitų produktų scenarijais.

Pateikti scenarijai yra būsimų veiklos rezultatų įvertis, pagrįstas ankstesniais duomenimis apie tai, kaip kinta investicijų vertė, ir nėra tikslus rodiklis. Gautinos sumos skirsis atsižvelgiant į rinkos veiklos rezultatus ir investicijos (produkto) laikymo laikotarpį.

Nepalankiausias scenarijus parodo, ką galėtumėte atgauti esant ekstremalioms rinkos sąlygoms, ir juo neatsižvelgiama į situaciją, kurioje negalėtume jums sumokėti.

Pateikti skaičiai rodo visas paties produkto išlaidas, bet gali neapimti visų išlaidų sumų, kurias mokate savo konsultantui arba platintojui. Šiais skaičiais neatsižvelgiama į jūsų asmeninę mokesstinę padėtį, kuri taip pat gali turėti įtakos sumai, kurią atgausite.

#### KAS ATSTITINKA, JEI VALDYMO ĮMONĖ NEGALI SUMOKĖTI IŠMOKŲ?

Investuotojas gali patirti finansinių nuostolių Subfondo įsipareigojimų nevykdymo atveju. Valdymo įmonė Subfondą sudarantį turtą valdo patikėjimo teise, laikydamasi Subfondo turto atskyrimo nuo Valdymo įmonės turto reikalavimo, todėl Valdymo įmonės bankroto atveju jos kreditoriai negalėtų išieškoti savo reikalavimų iš Subfondo turto.

Investicinis fondas ar Subfondas nedalyvauja kokiose nors garantijose, įskaitant įsipareigojimų investuotojams draudimo, sistemose. Todėl investuotojas į Investicinį fondą (Subfondą) turi būti pasirengęs prisiimti riziką, kad jis gali netekti visos į Subfondą investuotos sumos.

## KOKIOS YRA IŠLAIDOS?

### IŠLAIDOS PER TAM TIKRĄ LAIKOTARPĮ

Gražos sumažėjimo rodiklis rodo, kokį poveikį jūsų patiriamos bendrosios išlaidos turės galimai investicijų gražai. Bendrąsias išlaidas sudaro vienkartinės, einamosios ir papildomos išlaidos. Pateikiamos paties produkto sudėtinų išlaidų sumos per tris skirtingus laikymo laikotarpius. Į jas įtraukiamos ir galimos baudos už sutarties nutraukimą anksčiau laiko.

Skaiciai pateikiami darant prielaidą, kad investuojate 10 000 EUR. Atkreiptinas dėmesys, jog šie skaičiai yra įverčiai ir ateityje gali keistis. Šį produktą jums parduodantis arba jo klausimais konsultuojantis asmuo gali nustatyti ir kitus mokesčius. Jeigu taip, tas asmuo pateiks jums informaciją apie tokius mokesčius ir parodys, kokį poveikį bendrosios išlaidos ilgainiui turės jūsų investicijai.

Investicija 10 000 EUR			
Scenarijai	Jei išgryninsite po 1 metų	Jeigu išgryninsite po 3 metų	Jeigu išgryninsite po 5 metų
Bendrosios išlaidos	483,55	864,83	1140,45
Metinis poveikis gražai	4,84 %	2,97 %	2,39 %

Žemiau pateiktoje lentelėje nurodoma įvairių rūšių išlaidų poveikis kiekvienais metais jūsų galimai investicijų gražai rekomenduojamo laikymo laikotarpio pabaigoje bei įvairių išlaidų kategorijų reikšmė.

Šioje lentelėje pateikiamas metinis poveikis gražai			
Vienkartinės išlaidos	Investavimo išlaidos	3.00 %	Išlaidų, kurias patiriate, kai pradėsite investuoti, poveikis.
	Pasitraukimo išlaidos	-	Išlaidų, kurias patiriate, kai suėjus terminui baigiate investuoti, poveikis.
Einamosios išlaidos	Portfelio sandorių išlaidos	-	Mums perkant ir parduodant produkto pagrindines investicijas patiriamų išlaidų poveikis.
	Kitos einamosios išlaidos	1.00% - A klasė 1.00% - B klasė 0,83% - kitos išlaidos	Išlaidų, kurios kasmet skiriamos mums už jūsų investicijų valdymą ir administravimą poveikis.
Papildomos išlaidos	Veiklos rezultatais grindžiami mokesčiai	-	Veiklos rezultatais grindžiamo mokesčio poveikis. Šiuos mokesčius taikome, jeigu produkto veiklos rezultatai viršija jo lyginamąjį indeksą.
	Teisės į pelno dalį	20 % sėkmės mokestis nuo aukščiausios pasiektos vertės (angl. <i>High Water Mark</i> )	Teisių į pelno dalį poveikis.

## KIEK LAIKO TURĖČIAU JĮ LAIKYTI IR AR GALIU PINIGUS PASIIMTI ANKSČIAU?

**Rekomenduojamas laikymo laikotarpis: 1 metai.** Atitinkamai per konkrečius kalendorinius mėnesius tikimasi didesnių svyravimų finansų rinkose, todėl investuotojui tikslinga išlaikyti Subfondo investicinius vienetus ilgesnį laikotarpį, siekiant išvengti ženklaus Subfondo investicinio vieneto vertės kritimo. Atkreiptinas dėmesys, jog Investuotojui neišlaikius Subfondo investicinių vienetų rekomenduojamą laikotarpį, Investuotojui gali neatsipirkti investicija dėl nuskaitomų mokesčių Subfondo lygmenyje.

Investuotojai turi teisę pareikalauti išpirkti Subfondo investicinius vienetus bet kuriuo metu, t. y., minimalus reikalaujamas investicijos laikymo laikotarpis nėra nustatomas. Subfondo investiciniai vienetai išperkami pateikiant nustatytos formos išpirkimo paraišką ne vėliau kaip iki paskutinės einamojo mėnesio darbo dienos 12:00 val. (t. y., Subfondo investiciniai vienetai išperkami kartą per mėnesį). Išpirkimo paraišką pateiktą nurodytu terminu, vykdomos grynųjų aktyvų vertės apskaičiavimo ir paskelbimo dieną, t. y., ne vėliau kaip iki penktosios kito mėnesio darbo dienos 12:00 val.

## KAIP GALIMA PATEIKTI SKUNDĄ?

Skundą Valdymo įmonei pateikti galima asmeniškai atvykus į Valdymo įmonę adresu A. Tumėno g. 4, Vilnius (darbo laikas 9:00 – 17:00), išsiunčiant skundą prieš tai nurodytu Valdymo įmonės adresu arba pateikiant skundą elektroniniu paštu oam@orion.lt. Skunde turi būti pateikiama ši informacija: skundą pateikiančio asmens vardas, pavardė ir asmens kodas / įmonės pavadinimas ir įmonės kodas, atstovo vardas, pavardė ir asmens kodas; skundo data; aiškiai išdėstyta skundo esmė; dokumentai, galintys turėti poveikį skundo nagrinėjimui; kontaktinė informacija (korespondencijos adresas, telefono numeris, elektroninio pašto adresas); skundas turi būti pasirašytas. Valdymo įmonės skundų nagrinėjimo taisyklės pateikiamos Valdymo įmonės interneto svetainėje am.orion.lt.

## KITA SVARBI INFORMACIJA

Vadovaujantis teisės aktų reikalavimais, prieš Subfondo investicinių vienetų įsigijimo sutarties sudarymą, Valdymo įmonė investuotojui pateikia Investicinio fondo taisykles, prospektą ir Investicinio fondo (Subfondo) metų veiklos ataskaitą. Po Subfondo investicinių vienetų įsigijimo sutarties sudarymo, Valdymo įmonė Investuotojui pareikalavus teikia Investicinio fondo prospektą, taisykles, Subfondo pusmečio veiklos ataskaitą, Investicinio fondo (Subfondo) ir Valdymo įmonės metų veiklos ataskaitą su auditoriaus išvada.

Investuotojams informacija apie Subfondo investicinio vieneto vertę paskelbiama kartą per mėnesį.