



Данный документ содержит ключевую информацию о фонде и не является маркетинговым материалом. Документ предназначен для информирования инвестора о понятии и степени риска инвестирования в фонд. Рекомендуется к ознакомлению для принятия взвешенного решения об инвестировании.

FLAG Quantitative Strategies Fund

Код ISIN:
Акция Класса А USD: KYG352931029

Цели и инвестиционная политика

Цель. Торговые стратегии Фонда направлены на использование кратковременной неэффективности в образовании цен ликвидных финансовых инструментов. Эти стратегии реализуются посредством разработки алгоритмических торговых систем.

Политика. Фонд инвестирует преимущественно в торгуемые на бирже долевые и долговые ценные бумаги эмитентов, связанных со странами СНГ, а также в индексы и деривативы на основе этих бумаг. Применяются также ориентированные на страны СНГ стратегии торговли на валютном и товарно-сырьевом рынках. Ценные бумаги и деривативы, торгуемые на глобальных развивающихся и развитых рынках и не относящиеся к странам СНГ, могут использоваться в инвестиционной стратегии главным образом в контексте хеджирования рисков. По мере развития бизнеса и стратегий Фонда такие бумаги и деривативы могут включаться в его основные инвестиционные стратегии по усмотрению инвестиционного управляющего. При реализации своей инвестиционной стратегии Фонд не связан какими-либо ограничениями в отношении типов транзакций, которые он может осуществлять.

Страна регистрации	Каймановы острова
Дата начала операций	2 июня 2014 г.
Валюта отчетности	USD
Подписка/вывод средств	ежемесячно
Отчетность по СЧА	ежемесячно
Минимальный размер подписки	USD 250 000

Ограничения. Акции Фонда предлагаются только правомочным инвесторам. В соответствии с Законом Каймановых островов об инвестициях в ценные бумаги правомочными инвесторами являются:

- квалифицированный инвестор (имеющая листинг или подлежащая регулированию организация либо опытный инвестор, вкладывающий в одну транзакцию более USD 100 000);
- состоятельное лицо (физическое лицо с состоянием не менее USD 1 000 000 или лицо с общей суммой активов не менее USD 5 000 000);
- организация, инвесторы которой являются либо квалифицированными инвесторами, либо состоятельными лицами.

Рекомендации. Особые рекомендации отсутствуют.

Профиль риска и доходности

Снижение риска

Рост риска

Снижение возможной доходности

Рост возможной доходности

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

Этот показатель характеризует величину колебаний цены акций данного класса на основе истории ее изменений. As the Поскольку динамика риска, связанного с акциями этого класса, рассчитана с использованием исторических и смоделированных данных за тот период, когда исторические данные были недоступны, этот показатель может быть ненадежным при определении будущего профиля риска акций данного класса. Указанная категория риска может изменяться в будущем и не гарантируется. Самая низкая категория не является безрисковой.

Прочие риски

Стоимость инвестиций и доход от них может как вырасти, так и уменьшиться, и вы можете потерять часть или всю вложенную сумму. Фонд может инвестировать в ценные бумаги, с которыми связан существенный риск потери капитала. Изменения процентных ставок вызывают колебания стоимости Фонда. Фонд может использовать плечо или открывать короткие позиции, что может привести к значительной доле заемных средств на счетах Фонда. Фонд может использовать деривативы (производные инструменты) для хеджирования и инвестиций, в результате чего стоимость Фонда может подвергаться серьезным колебаниям.

Учитывайте валютный риск. Вы можете получать выплаты в другой валюте, и в этом случае окончательная доходность для вас будет зависеть от курса одной валюты к другой. Этот риск не учтен в приведенном выше показателе.

Приведенный выше показатель также не учитывает другие существенные риски, в том числе риск контрагента (риск неисполнения контрагентами Фонда своих обязательств), риск ликвидности (риск наступления неблагоприятных рыночных условий, приводящих к невозможности продажи активов при необходимости) и операционные риски (риски отказов или ошибок при предоставлении обслуживания поставщиками Фонда).

Расходы инвестора

Разовые сборы до или после инвестирования:

Надбавка при покупке	Нет
Скидка при погашении	Нет

Это максимальный размер сборов, которые могут вычитаться из ваших средств до их инвестирования.

Сборы из средств фонда в течение года:

Текущие расходы	0,28%
-----------------	-------

Сборы из средств фонда при определенных условиях:

Комиссия за успех	20%
Комиссия за консультации	2%

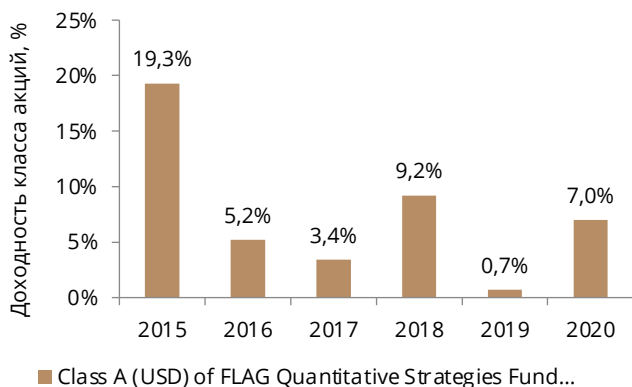
Взимаемые с вас средства используются для оплаты работы Фонда, в том числе для покрытия расходов Фонда на маркетинг и дистрибуцию. Эти сборы уменьшают возможный уровень роста инвестиций.

Текущие расходы определены исходя из суммы расходов за год, закончившийся 31 декабря 2020 г. Эта цифра может изменяться из года в год.

Подробную информацию о сборах см. в разделах SPECIFICS OF CERTAIN FEES AND EXPENSES и/или SUMMARY OF FEES AND EXPENSES действующего документа Offering Supplement of FLAG Quantitative Strategies Fund.

Сбор на текущие расходы одинаков для всех инвесторов.

Доходность за прошлые периоды



Дата начала операций Фонда: 2 июня 2014 г.

Базовая валюта фонда — доллар США (USD), доходность класса акций рассчитана в USD.

Годовая доходность рассчитана по доступным данным за полные 12-месячные периоды, заканчивавшиеся 31 декабря.

Показатели доходности за прошлые периоды не являются ориентиром для определения будущей доходности.

Доходность рассчитывается после вычета текущих расходов и при предполагаемом реинвестировании дохода.

Полезная информация

Фонд представляет собой освобожденную компанию, зарегистрированную как компания с ограниченной ответственностью в соответствии с законодательством Каймановых островов и как паевой (взаимный) инвестиционный фонд в соответствии с Законом о паевых (взаимных) инвестиционных фондах (с внесенными в него поправками) Каймановых островов.

Ограничение ответственности. Управляющий может быть привлечен к ответственности исключительно на основании какого-либо заявления в настоящем документе, вводящего в заблуждение, являющегося неточным или противоречащего соответствующим разделам проспекта.

Налоги. Обратите внимание: режим налогообложения, действующий на Каймановых островах, может повлиять на ваш персональный налоговый статус. Пожалуйста, перед инвестированием проконсультируйтесь со своим финансовым или налоговым советником.

Дополнительная информация. В данном документе ("Ключевая информация для инвесторов", KIID) может содержаться не вся необходимая вам информация. Дополнительные сведения о Фонде (включая Private Placement Memorandum (PPM) и Offering Supplement (OS)), годовые и ежемесячные отчеты, а также сведения о доходности Фонда и текущей цене акций можно заказать, отправив заявку по адресу электронной почты info@flaginvest.com. Документы PPM и OS представлены на английском языке. В данном документе содержится информация об одном из классов акций Фонда. При подготовке проспекта, а также годовых и ежемесячных отчетов для акционеров используются данные обо всем Фонде и всех классах акций.

Инвестиционный управляющий

FLAG Quantitative Investment Management Limited
Cayman Corporate Centre
27 Hospital Road
George Town
Grand Cayman KY1-9008
Cayman Islands

Администратор

CyproFund Administration

Services Limited
5 Esperidon Str., 4th Floor
1087 Nicosia, Cyprus

Депозитарий/ прайм-брокер

Фонд пользуется услугами различных депозитариев и прайм-брокеров.

Политика вознаграждений. У инвестиционного менеджера нет политики вознаграждений в связи с отсутствием подобного обязательства на Каймановых островах. Для получения дополнительной информации пишите нам по адресу электронной почты info@flaginvest.com.

Адрес: Cayman Corporate Centre, 27 Hospital Road, George Town, Grand Cayman KY1-9008, Cayman Islands

Дата публикации. Изложенная здесь ключевая информация для инвесторов актуальна на 1 марта 2021 г.