INFORMACJA DLA KLIENTA ALTERNATYWNEGO FUNDUSZU INWESTYCYJNEGO

ROCKBRIDGE FUNDUSZ INWESTYCYJNY ZAMKNIĘTY ABSOLUTE RETURN FIXED INCOME

OKRESOWE UJAWNIENIA

sporządzona na dzień 30 czerwca 2019 r. za okres sprawozdawczy od 1 stycznia 2019 r. do 30 czerwca 2019 r.

Niniejsza informacja sporządzona jest w związku z art. 222 b ustawy z dnia 27 maja 2004 r. o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (tj. Dz. U. z 2016 r., poz. 1896 z poźn. zm.; „Ustawa"), stosownie do treści Informacji dla Klienta Alternatywnego Funduszu Inwestycyjnego („IDK")

Zakres informacji	*Termin udostępnienia*	*Sposób udostępnienia*
Towarzystwo, na podstawie art. 222b Ustawy z uwzględnieniem art. 108 i art. 109 Rozporządzenia 231/2013[1], udostępnia informacje o: a) udziale procentowym aktywów, które są przedmiotem specjalnych ustaleń w związku z ich niepłynnością, b) zmianach regulacji wewnętrznych dotyczących zarządzania płynnością, c) aktualnym profilu ryzyka oraz systemach zarządzania ryzykiem stosowanych przez podmiot nim zarządzający; d) łącznej wysokości zastosowanej dźwigni finansowej AFI.	Informacje te udostępniane są w terminach publikacji rocznych i półrocznych sprawozdań finansowych Funduszu.	Informacje udostępniane są na stronie internetowej www.rockbridge.pl
Towarzystwo, na podstawie art. 222b Ustawy z uwzględnieniem art. 108 i art. 109 Rozporządzenia 231/2013, udostępnia informacje o: a) zmianach maksymalnego poziomu Dźwigni finansowej AFI, który może być stosowany w imieniu Funduszu, oraz b) prawie do ponownego wykorzystania zabezpieczeń lub gwarancji udzielonej na podstawie porozumienia dotyczącego Dźwigni finansowej AFI.	Informacje te udostępniane są niezwłocznie po wystąpieniu zmiany.	Informacje udostępniane są w trybie aktualizacji IDK na stronie internetowej www.rockbridge.pl

[1] *Rozporządzenie Delegowane Komisji (UE) Nr 231/2013 z dnia 19 grudnia 2012 r. uzupełniające dyrektywę Parlamentu Europejskiego i Rady 2011/61/UE w odniesieniu do zwolnień, ogólnych warunków dotyczących prowadzenia działalności, depozytariuszy, dźwigni finansowej, przejrzystości i nadzoru (Dz. Urz. UE L 176 z 10.07.2010, str. 1).*

Procentowy udział aktywów, które są przedmiotem specjalnych ustaleń w związku z ich niepłynnością

W Funduszu nie obowiązują specjalne ustalenia w związku z niepłynnością aktywów, tj. szczególne uprawnienia dla inwestorów, regulujące w sposób odmienny uprawnienie do umorzenia certyfikatów na wypadek niepłynności aktywów Funduszu.

Informacja o zmianach regulacji wewnętrznych dotyczących zarządzania płynnością

W okresie sprawozdawczym wewnętrzne regulacje dotyczące zarządzania płynnością Funduszu nie podlegały zmianom.

Aktualny profil ryzyka oraz informacja o systemie zarządzania ryzykiem stosowanym przez Towarzystwo

System zarządzania ryzykiem obejmuje wszystkie komórki organizacyjne Towarzystwa. Departament Zarządzania Ryzykiem odpowiedzialny za nadzór nad systemem zarządzania ryzykiem podlega bezpośrednio Zarządowi a także przedstawia regularne sprawozdania Radzie Nadzorczej Towarzystwa sprawującej nadzór na systemami kontroli wewnętrznej i zarządzania ryzykiem. System zarządzania ryzykiem działa w oparciu o komitety produktowe a także Komitet Nadzoru, sprawujący nadrzędną rolę w procesie ograniczania ryzyka w Towarzystwie. System zarządzania ryzykiem podlega ocenie biegłego rewidenta przynajmniej raz do roku.

W ramach systemu zarzadzania ryzykiem Towarzystwo identyfikuje ryzyka w zarządzanych funduszach i dla wszystkich istotnych czynników ryzyka ustanawia limity wewnętrzne będące uzupełnieniem zapisów statutowych w ramach ograniczania zaangażowania w poszczególne czynniki ryzyka. W szczególności Towarzystwo identyfikuje profil płynności funduszy i ustanawia maksymalne zaangażowania w instrumenty o ograniczonej płynności. System limitów wewnętrznych wspierany przez system alertów ostrzegawczych o charakterze informacyjnym.

Profil ryzyka funduszu definiowany jako zmienność stóp zwrotu z certyfikatu inwestycyjnego w horyzoncie rocznym według skali zdefiniowanej poniżej wyniósł 2.

Skala zmienności stóp zwrotu:
1 – zmienność stóp zwrotu z certyfikatu w przedziale 0%-0,5%
2 – zmienność stóp zwrotu z certyfikatu w przedziale 0,5%-2%
3 – zmienność stóp zwrotu z certyfikatu w przedziale 2%-5%
4 – zmienność stóp zwrotu z certyfikatu w przedziale 5%-10%
5 – zmienność stóp zwrotu z certyfikatu w przedziale 10%-15%
6 – zmienność stóp zwrotu z certyfikatu w przedziale 15%-20%
7 – zmienność stóp zwrotu z certyfikatu powyżej 20%

Łącznej wysokości zastosowanej dźwigni finansowej AFI na dzień bilansowy

Wysokość dźwigni finansowej AFI zastosowanej przez Fundusz obliczanej metodą zaangażowania jako suma WAN Funduszu, skompensowanej wartości referencyjnej instrumentów pochodnych oraz wartości pożyczek i transakcji *sell-buy-back* pomniejszonych o wartość bilansową instrumentów pochodnych wyniosła na dzień bilansowy 359% WAN.

Wysokość dźwigni finansowej AFI zastosowanej przez Fundusz obliczanej metodą brutto jako suma WAN Funduszu, nieskompensowanej wartości referencyjnej instrumentów pochodnych oraz wartości pożyczek i transakcji *sell-buy-back* pomniejszonych o wartość bilansową instrumentów pochodnych oraz gotówki i środków płynnych wyniosła na dzień bilansowy 464% WAN.