Rockbridge

Warszawa, 27 sierpnia 2020 r.

Szanowni Państwo,

przedstawiamy Państwu sprawozdanie finansowe **Rockbridge Funduszu Inwestycyjnego Zamkniętego Bezpieczna Inwestycja 5** („Fundusz") zarządzanego przez Rockbridge Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A., za okres od 1 stycznia do 30 czerwca 2020 roku.

Na koniec okresu sprawozdawczego wartość aktywów netto Funduszu wynosiła 14,3 mln złotych, natomiast łączna wartość aktywów netto zarządzanych przez Rockbridge Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. wyniosła 2,5 mld złotych.

Stopy zwrotu
W związku z prowadzoną polityką inwestycyjną w okresie sprawozdawczym wartość Certyfikatu Inwestycyjnego Funduszu wzrosła o 1,20%.

W okresie sprawozdawczym Fundusz stosował strategię zabezpieczania portfela akcji o nazwie Constant Proportion Portfolio Insurance (w skrócie „CPPI") polegającą na odpowiednim rebalansowaniu udziałów akcji i instrumentów dłużnych w portfelu w celu ochrony wartości aktywów netto Funduszu na Certyfikat Inwestycyjny przed spadkiem poniżej zakładanego poziomu, na koniec założonego każdorazowo okresu.
Fundusz będzie kontynuował stosowanie opisanej strategii w kolejnych latach.

Jesteśmy przekonani, że w drugiej połowie 2020 roku uwarunkowania rynkowe będą sprzyjały osiąganiu lepszych wyników przez fundusze inwestycyjne, którymi zarządzamy. Dziękujemy za okazane nam zaufanie.

Z wyrazami szacunku,

Krzysztof Mazurek — Prezes Zarządu

Witold Chuść — Wiceprezes Zarządu