**INFORMACJA DLA KLIENTA ALTERNATYWNEGO FUNDUSZU INWESTYCYJNEGO**

**ROCKBRIDGE NEO SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY**

**OKRESOWE UJAWNIENIA**

**sporządzona na dzień 31 grudnia 2022 r. za okres sprawozdawczy od 1 stycznia – 31 grudnia 2022 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 2022 r., poz. 1523 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:<br>a) udziale procentowym aktywów, które są przedmiotem specjalnych ustaleń w związku z ich niepłynnością,<br>b) zmianach regulacji wewnętrznych dotyczących zarządzania płynnością,<br>c) aktualnym profilu ryzyka oraz systemach zarządzania ryzykiem stosowanych przez podmiot nim zarządzający;<br>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:<br>a) zmianach maksymalnego poziomu Dźwigni finansowej AFI, który może być stosowany w imieniu Funduszu, oraz<br>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 |

**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.

[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).*

**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 definiowany jako SRI (Summary Risk Indicator), czyli wskaźnik ryzyka wyliczany w oparciu o metodologię przewidzianą w rozporządzeniu delegowanym Komisji (UE) 2017/653 z dnia 8 marca 2017 r. uzupełniającym rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 1286/2014 w sprawie dokumentów zawierających kluczowe informacje, dotyczących detalicznych produktów zbiorowego inwestowania i ubezpieczeniowych produktów inwestycyjnych (PRIIP) przez ustanowienie regulacyjnych standardów technicznych w zakresie prezentacji, treści, przeglądu i zmiany dokumentów zawierających kluczowe informacje oraz warunków spełnienia wymogu przekazania takich dokumentów (Rozporządzenie PRIIP). Wskaźnik SRI przyjmuje wartość liczby całkowitej z zakresu <1,7>.

Na datę bilansową profil ryzyka poszczególnych subfunduszy wydzielonych w ramach Rockbridge Neo SFIO wyniósł:

| Nazwa Subfunduszu | SRI |
|---|---|
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Ochrony Wzrostu | 2 |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Obligacji Plus | 3 |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Obligacji Światowych | 3 |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Zrównoważony Azjatycki | 4 |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Rynków Wschodzących | 4 |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Rynków Rozwiniętych | 4 |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Chińskich i Azjatyckich | 4 |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Amerykańskich | 4 |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Konserwatywny Plus | 2 |

| | |
|---|---|
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Polskich | 4 |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Nowa Europa | 5 |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Małych Spółek | 4 |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Ameryki Łacińskiej | 5 |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Europejskich | 4 |

**Łącznej wysokości zastosowanej dźwigni finansowej AFI na dzień bilansowy**

Łączna ekspozycja wyznaczona metodą zaangażowania wyniosła na dzień 31 grudnia 2022 r.:

| Nazwa Subfunduszu | AFI - ekspozycja obliczona metodą zaangażowania |
|---|---|
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Ochrony Wzrostu | 100,05% |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Obligacji Plus | 100,00% |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Obligacji Światowych | 118,89% |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Zrównoważony Azjatycki | 100,00% |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Rynków Wschodzących | 136,61% |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Rynków Rozwiniętych | 133,08% |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Chińskich i Azjatyckich | 100,07% |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Amerykańskich | 100,00% |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Konserwatywny Plus | 100,00% |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Polskich | 104,71% |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Nowa Europa | 100,00% |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Małych Spółek | 104,94% |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Ameryki Łacińskiej | 123,88% |
| Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Europejskich | 100,90% |

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Krzysztof Mazurek
Data: 2023.04.26 12:14:35 CEST

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Witold Chuść
Data: 2023.04.26 12:19:59 CEST

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Piotr Tadeusz Franaszczuk
Data: 2023.04.26 12:36:00 CEST

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Jakub Ryba
Data: 2023.04.26 12:47:19 CEST

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Michał Tuczyński
Data: 2023.04.26 13:08:50 CEST