

**Komunikat w sprawie zmiany Statutu  
Rockbridge Funduszu Inwestycyjnego Otwartego Parasolowego**

Rockbridge Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. na podstawie art. 24 ust. 5 oraz art. 24 ust. 8 pkt 1 ustawy z dnia 27 maja 2004 r. o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (Dz.U. z 2024 r., poz. 1034 ze zm.) niniejszym ogłasza zmiany statutu Rockbridge Funduszu Inwestycyjnego Otwartego Parasolowego polegające na tym, że:

- 1) w art. 1:
  - a) pkt 12a otrzymuje brzmienie:

*„12a. Instrumenty dające ekspozycję na rynek akcji – następujące rodzaje instrumentów finansowych: akcje, obligacje zamienne na akcje, prawa do akcji, prawa poboru, kwity depozytowe, warranty subskrypcyjne uprawniające do objęcia akcji, inne zbywalne papiery wartościowe inkorporujące prawa majątkowe odpowiadające prawom z akcji, instrumenty pochodne typu futures, dla których instrumentem bazowym są akcje lub indeksy giełdowe akcji, a także jednostki uczestnictwa funduszy inwestycyjnych otwartych lub certyfikaty inwestycyjne emitowane przez fundusze inwestycyjne zamknięte mające siedzibę na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej lub tytuły uczestnictwa emitowane przez fundusze zagraniczne lub instytucje wspólnego inwestowania mające siedzibę za granicą, spełniające warunki, o których mowa w art. 9 ust. 4 lit. c) Statutu, których polityka inwestycyjna przewiduje lokowanie co najmniej 70% swoich aktywów w instrumenty udziałowe lub instrumenty odzwierciedlające skład indeksu akcji.”*
  - b) po pkt 26 dodaje się pkt 26a w brzmieniu:

*„26a. Rozporządzenie w sprawie prowadzenia działalności przez towarzystwa funduszy inwestycyjnych - rozporządzenie Ministra Finansów, Funduszy i Polityki Regionalnej z dnia 18 listopada 2020 r. w sprawie sposobu, trybu oraz warunków prowadzenia działalności przez towarzystwa funduszy inwestycyjnych (Dz.U. z 2020 r., poz. 2103 z późn. zm.).”*
- 2) w art. 50 po ust. 8 dodaje się ust. 9 w brzmieniu:

*„9. Całkowita ekspozycja Subfunduszu obliczana jest metodą zaangażowania zgodnie z Rozporządzeniem w sprawie prowadzenia działalności przez towarzystwa funduszy inwestycyjnych.”*
- 3) w art. 56:
  - a) ust. 3 otrzymuje brzmienie:

*„3. Fundusz inwestuje nie mniej niż 70% (siedemdziesiąt procent) WANS w Instrumenty dające ekspozycję na rynek akcji spółek wchodzących w skład indeksu mWIG40.”*
  - b) po ust. 8 dodaje się ust. 9 w brzmieniu:

*„9. Całkowita ekspozycja Subfunduszu obliczana jest metodą zaangażowania zgodnie z Rozporządzeniem w sprawie prowadzenia działalności przez towarzystwa funduszy inwestycyjnych.”*
- 4) w art. 62b ust. 1 otrzymuje brzmienie:

*„1. Podstawowym kryterium doboru lokat jest uzyskiwanie możliwie wysokiej stopy zwrotu przy jednoczesnym minimalizowaniu ryzyka związanego z niewypłacalnością emitenta, ryzyka zmienności stóp procentowych i ryzyka ograniczonej płynności. W tym celu Fundusz będzie dokonywał inwestycji głównie w Instrumenty dające ekspozycję na rynek akcji emitowane przez podmioty mające siedzibę lub prowadzące większość swojej działalności w krajach zaliczanych do tzw. rynków wschodzących, a w przypadku tytułów uczestnictwa emitowanych przez fundusze zagraniczne lub instytucje wspólnego inwestowania mające siedzibę za granicą, spełniające warunki, o których mowa w art. 9 ust. 4 lit. c) Statutu, których polityka inwestycyjna zakłada lokowanie w instrumenty finansowe zapewniające ekspozycję na rynki akcji w tych krajach. Rynki wschodzące obejmują kraje wchodzące w skład indeksu MSCI Emerging Markets, obliczanego i publikowanego przez MSCI Inc.”;*

5) w art. 63:

a) ust. 3 otrzymuje brzmienie:

*„3. Fundusz inwestuje co najmniej 70% (siedemdziesiąt procent) WANS w Instrumenty dające ekspozycję na rynek akcji emitowane przez podmioty mające siedzibę lub prowadzące większość swojej działalności w krajach zaliczanych do rynków wschodzących, o których mowa w art. 62b ust. 1, a w przypadku tytułów uczestnictwa emitowanych przez fundusze zagraniczne lub instytucje wspólnego inwestowania mające siedzibę za granicą, spełniające warunki, o których mowa w art. 9 ust. 4 lit. c) Statutu, których polityka inwestycyjna zakłada lokowanie w instrumenty finansowe zapewniające ekspozycję na rynki akcji w tych krajach.”;*

b) dodaje się ust. 9 w brzmieniu:

*„9. Całkowita ekspozycja Subfunduszu obliczana jest metodą zaangażowania zgodnie z Rozporządzeniem w sprawie prowadzenia działalności przez towarzystwa funduszy inwestycyjnych.”;*

6) w art. 71:

a) ust. 2 otrzymuje brzmienie:

*„2. Fundusz lokuje nie mniej niż 40% (czterdzieści procent) lecz nie więcej niż 60% (sześćdziesiąt procent) WANS w Instrumenty dające ekspozycję na rynek akcji.”;*

b) po ust. 2 dodaje się ust. 2a w brzmieniu:

*„2a. Instrumenty dłużne, tj. obligacje, bony skarbowe, papiery komercyjne, listy zastawne, certyfikaty depozytowe oraz Instrumenty Rynku Pieniężnego, depozyty bankowe, papiery wartościowe nabyte przez Fundusz, co do których istnieje zobowiązanie drugiej strony do ich odkupu, i należności a także jednostki uczestnictwa, certyfikaty inwestycyjne lub tytuły uczestnictwa instytucji zbiorowego inwestowania, których polityka inwestycyjna zakłada lokowanie w instrumenty finansowe zapewniające ekspozycję na instrumenty dłużne lub stopę procentową oraz wartość nominalna instrumentów pochodnych, dla których bazę stanowią obligacje bądź stopa procentowa, stanowią nie mniej niż 40% (czterdzieści procent) WANS.”;*

c) po ust. 11 dodaje się ust. 12 w brzmieniu:

*„12. Całkowita ekspozycja Subfunduszu obliczana jest metodą zaangażowania zgodnie z Rozporządzeniem w sprawie prowadzenia działalności przez towarzystwa funduszy inwestycyjnych.”;*

- 7) w art. 77:
- a) ust. 2 otrzymuje brzmienie:  
*„2. Instrumenty dłużne emitowane przez przedsiębiorstwa, takie jak obligacje, papiery komercyjne, listy zastawne, certyfikaty depozytowe, Instrumenty Rynku Pieniężnego a także jednostki uczestnictwa, certyfikaty inwestycyjne lub tytuły uczestnictwa instytucji zbiorowego inwestowania, których polityka inwestycyjna zakłada lokowanie w instrumenty finansowe zapewniające ekspozycję na rynek obligacji korporacyjnych stanowią co najmniej 70% (siedemdziesiąt procent) WANS.”,*
  - b) po ust. 2 dodaje się ust. 2a w brzmieniu:  
*„2a. Poziom wrażliwości wyceny portfela Subfunduszu na zmianę stóp procentowych (duracja) będzie się zawierać w przedziale 0-6.”,*
  - c) dodaje się ust. 11 w brzmieniu:  
*„11. Całkowita ekspozycja Subfunduszu obliczana jest metodą zaangażowania zgodnie z Rozporządzeniem w sprawie prowadzenia działalności przez towarzystwa funduszy inwestycyjnych.”;*
- 8) w art. 91:
- a) ust. 2 otrzymuje brzmienie:  
*„2. Instrumenty dłużne, tj. obligacje, bony skarbowe, papiery komercyjne, listy zastawne, certyfikaty depozytowe oraz Instrumenty Rynku Pieniężnego, depozyty bankowe, papiery wartościowe nabyte przez Fundusz, co do których istnieje zobowiązanie drugiej strony do ich odkupu, i należności a także jednostki uczestnictwa, certyfikaty inwestycyjne lub tytuły uczestnictwa instytucji zbiorowego inwestowania, których polityka inwestycyjna zakłada lokowanie w instrumenty finansowe zapewniające ekspozycję na instrumenty dłużne lub stopę procentową oraz wartość nominalna instrumentów pochodnych, dla których bazę stanowią obligacje bądź stopa procentowa stanowią co najmniej 70% (siedemdziesiąt procent) WANS.”,*
  - b) po ust. 2 dodaje się ust. 2a w brzmieniu:  
*„2a. Poziom wrażliwości wyceny portfela Subfunduszu na zmianę stóp procentowych (duracja) będzie się zawierać w przedziale od (-1) do 8.”;*
  - c) po ust. 10 dodaje się ust. 11 w brzmieniu:  
*„11. Całkowita ekspozycja Subfunduszu obliczana jest metodą zaangażowania zgodnie z Rozporządzeniem w sprawie prowadzenia działalności przez towarzystwa funduszy inwestycyjnych.”;*
- 9) w art. 97:
- a) ust. 2 otrzymuje brzmienie:  
*„2. Instrumenty dłużne, tj. obligacje, bony skarbowe, papiery komercyjne, listy zastawne, certyfikaty depozytowe oraz Instrumenty Rynku Pieniężnego, depozyty bankowe, papiery wartościowe nabyte przez Fundusz, co do których istnieje zobowiązanie drugiej strony do ich odkupu, i należności a także jednostki uczestnictwa, certyfikaty inwestycyjne lub tytuły uczestnictwa instytucji zbiorowego inwestowania, których polityka inwestycyjna zakłada lokowanie w instrumenty finansowe zapewniające ekspozycję na instrumenty dłużne lub stopę procentową oraz wartość nominalna instrumentów pochodnych, dla których bazę stanowią obligacje bądź stopa procentowa stanowią co najmniej 70% (siedemdziesiąt procent)*

WANS.”,

- b) po ust. 2 dodaje się ust. 2a w brzmieniu:  
*„2a. Poziom wrażliwości wyceny portfela Subfunduszu na zmianę stóp procentowych (duracja) będzie się zawierać w przedziale od 1 do 11.”,*
- c) po ust. 10 dodaje się ust. 11 w brzmieniu:  
*„11. Całkowita ekspozycja Subfunduszu obliczana jest metodą zaangażowania zgodnie z Rozporządzeniem w sprawie prowadzenia działalności przez towarzystwa funduszy inwestycyjnych.”;*

**10)** w art. 103:

- a) ust. 2 otrzymuje brzmienie:  
*„2. Instrumenty dłużne, tj. obligacje, bony skarbowe, papiery komercyjne, listy zastawne, certyfikaty depozytowe oraz Instrumenty Rynku Pieniężnego, depozyty bankowe, papiery wartościowe nabyte przez Fundusz, co do których istnieje zobowiązanie drugiej strony do ich odkupu, i należności a także jednostki uczestnictwa, certyfikaty inwestycyjne lub tytuły uczestnictwa instytucji zbiorowego inwestowania, których polityka inwestycyjna zakłada lokowanie w instrumenty finansowe zapewniające ekspozycję na instrumenty dłużne lub stopę procentową oraz wartość nominalna instrumentów pochodnych, dla których bazę stanowią obligacje bądź stopa procentowa stanowią co najmniej 70% (siedemdziesiąt procent) WANS.”,*
- b) po ust. 2 dodaje się ust. 2a w brzmieniu:  
*„2a. Poziom wrażliwości wyceny portfela Subfunduszu na zmianę stóp procentowych (duracja) będzie się zawierać w przedziale od (- 2) do 5.”;*
- c) po ust. 11 dodaje się ust. 12 w brzmieniu:  
*„12. Całkowita ekspozycja Subfunduszu obliczana jest metodą zaangażowania zgodnie z Rozporządzeniem w sprawie prowadzenia działalności przez towarzystwa funduszy inwestycyjnych.”;*

**11)** w art. 109:

- a) po ust. 2 dodaje się ust. 2a w brzmieniu:  
*„2a. Instrumenty dłużne, tj. obligacje, bony skarbowe, papiery komercyjne, listy zastawne, certyfikaty depozytowe oraz Instrumenty Rynku Pieniężnego, depozyty bankowe, papiery wartościowe nabyte przez Fundusz, co do których istnieje zobowiązanie drugiej strony do ich odkupu, i należności a także jednostki uczestnictwa, certyfikaty inwestycyjne lub tytuły uczestnictwa instytucji zbiorowego inwestowania, których polityka inwestycyjna zakłada lokowanie w instrumenty finansowe zapewniające ekspozycję na instrumenty dłużne lub stopę procentową oraz wartość nominalna instrumentów pochodnych, dla których bazę stanowią obligacje bądź stopa procentowa stanowią nie mniej niż 60% (sześćdziesiąt procent) WANS.”,*
- b) po ust. 11 dodaje się ust. 12 w brzmieniu:  
*„12. Całkowita ekspozycja Subfunduszu obliczana jest metodą zaangażowania zgodnie z Rozporządzeniem w sprawie prowadzenia działalności przez towarzystwa funduszy inwestycyjnych.”;*

**12)** w art. 114b ust. 1 otrzymuje brzmienie:

- „1. Podstawowym kryterium doboru lokat jest uzyskiwanie możliwie wysokiej stopy*

zwrotu przy jednoczesnym minimalizowaniu ryzyka związanego z niewypłacalnością emitenta, ryzyka zmienności stóp procentowych i ryzyka ograniczonej płynności. W tym celu Subfundusz będzie dokonywał inwestycji głównie w Instrumenty dające ekspozycję na rynek akcji emitowane przez podmioty mające siedzibę lub prowadzące większość swojej działalności w krajach zaliczanych do tzw. rynków rozwiniętych, a w przypadku tytułów uczestnictwa emitowanych przez fundusze zagraniczne lub instytucje wspólnego inwestowania mające siedzibę za granicą, spełniające warunki, o których mowa w art. 9 ust. 4 lit. c) Statutu, których polityka inwestycyjna zakłada lokowanie w instrumenty finansowe zapewniające ekspozycję na rynki akcji w tych krajach. Rynki rozwinięte obejmują kraje wchodzące w skład indeksu MSCI World, obliczanego i publikowanego przez MSCI Inc.”;

**13)** w art. 115:

a) ust. 3 otrzymuje brzmienie:

*„3. Fundusz inwestuje co najmniej 70% (siedemdziesiąt procent) WANS w Instrumenty dające ekspozycję na rynek akcji emitowane przez podmioty mające siedzibę lub prowadzące większość swojej działalności w krajach zaliczanych do rynków rozwiniętych, o których mowa w art. 114b ust. 1, a w przypadku tytułów uczestnictwa emitowanych przez fundusze zagraniczne lub instytucje wspólnego inwestowania mające siedzibę za granicą, spełniające warunki, o których mowa w art. 9 ust. 4 lit. c) Statutu, których polityka inwestycyjna zakłada lokowanie w instrumenty finansowe zapewniające ekspozycję na rynki akcji w tych krajach.”,*

b) dodaje się ust. 9 w brzmieniu:

*„9. Całkowita ekspozycja Subfunduszu obliczana jest metodą zaangażowania zgodnie z Rozporządzeniem w sprawie prowadzenia działalności przez towarzystwa funduszy inwestycyjnych.”;*

**14)** w art. 121 dodaje się ust. 9 w brzmieniu:

*„9. Całkowita ekspozycja Subfunduszu obliczana jest metodą zaangażowania zgodnie z Rozporządzeniem w sprawie prowadzenia działalności przez towarzystwa funduszy inwestycyjnych.”;*

**15)** w art. 132b ust. 1 otrzymuje brzmienie:

*„1. Subfundusz inwestuje głównie w spółki z różnych branż gospodarki, które na podstawie analizy fundamentalnej są niedowartościowane względem swojej wartości wewnętrznej. Dobór spółek do portfela lokat Subfunduszu prowadzony jest z uwzględnieniem prowadzenia przez spółki ugruntowanej polityki wynagradzania akcjonariuszy, ze szczególnym naciskiem na spółki, które dzięki swoim modelom biznesowym i generowanym wynikom są w stanie zwiększać poziom wypłacanego wynagrodzenia. Fundusz dąży do dywersyfikacji sektorowej lokat Subfunduszu.”;*

**16)** w art. 133 po ust. 11 dodaje się ust. 12 w brzmieniu:

*„12. Całkowita ekspozycja Subfunduszu obliczana jest metodą zaangażowania zgodnie z Rozporządzeniem w sprawie prowadzenia działalności przez towarzystwa funduszy inwestycyjnych.”;*

**17)** w art. 139:

a) ust. 2 otrzymuje brzmienie:

*„2. Instrumenty dłużne, tj. obligacje, bony skarbowe, papiery komercyjne, listy zastawne, certyfikaty depozytowe oraz Instrumenty Rynku Pieniężnego, depozyty*

*bankowe, papiery wartościowe nabyte przez Fundusz, co do których istnieje zobowiązanie drugiej strony do ich odkupu, i należności a także jednostki uczestnictwa, certyfikaty inwestycyjne lub tytuły uczestnictwa instytucji zbiorowego inwestowania, których polityka inwestycyjna zakłada lokowanie w instrumenty finansowe zapewniające ekspozycję na instrumenty dłużne lub stopę procentową oraz wartość nominalna instrumentów pochodnych, dla których bazę stanowią obligacje bądź stopa procentowa stanowią co najmniej 70% (siedemdziesiąt procent) WANS.”,*

- b) po ust. 2 dodaje się ust. 2a w brzmieniu:  
*„2a. Poziom wrażliwości wyceny portfela Subfunduszu na zmianę stóp procentowych (duracja) będzie się zawierać w przedziale od (- 1) do 5.”,*
- c) po ust. 11 dodaje się ust. 12 w brzmieniu:  
*„12. Całkowita ekspozycja Subfunduszu obliczana jest metodą zaangażowania zgodnie z Rozporządzeniem w sprawie prowadzenia działalności przez towarzystwa funduszy inwestycyjnych.”.*

**Wskazane powyżej zmiany Statutu Funduszu wchodzi w życie w terminie 3 miesięcy od ogłoszenia, tj. w dniu 30 grudnia 2024 r.**

**Zmiany Statutu Funduszu nie wymagały uzyskania zezwolenia Komisji Nadzoru Finansowego.**