Rockbridge

Warszawa dnia 1 października 2026 r.

Komunikat w sprawie zmiany Statutu
Rockbridge NEO Specjalistycznego Funduszu Inwestycyjnego Otwartego

Rockbridge Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. na podstawie art. 24 ust. 5 oraz ust. 6 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 NEO Specjalistycznego Funduszu Inwestycyjnego Otwartego polegające na tym, że:

1) **w § 18a ust. 11**:
   a) **pkt 1** otrzymuje brzmienie:

„1) wyliczenie punktu odniesienia

$$BENCH_t = \prod_{n=1}^{t}(1 + r_{BENCHn})$$

$$r_{POLONIAt} = (1 + POLONIA_{t-1})^{\wedge(\frac{LD}{365})} - 1$$

$$r_{BENCHt} = 10\%\, r_{POLONIAt} + 90\% \frac{TBSP_t - TBSP_{t-1}}{TBSP_{t-1}}$$

   b) **w części „*Definicje*” wyrazy**:

„WIBOR ON$_t$ – stawka oprocentowania pożyczek overnight na rynku międzybankowym na Dzień Wyceny t (dla dni kalendarzowych, w których stawka WIBOR ON nie jest publikowana, przyjmuje się stawkę z ostatniego dnia, w którym stawka była publikowana)
$r_{WIBOR\ ONt}$ – stopa zwrotu z WIBOR ON w okresie od Dnia Wyceny t-LD do Dnia Wyceny t”
zastępuje się wyrazami:
„POLONIA$_t$ – stawka procentowa ustalana przez NBP jako średnia rentowność transakcji niezabezpieczonych, zawartych pomiędzy bankami biorącymi udział w fixingu, do godziny 16.30 w danym dniu roboczym, polegająca na przyjęciu lub złożeniu środków pieniężnych w PLN na termin overnight, ważona kwotami tych transakcji (symbol Bloomberg: PZCFPLNI Index) publikowana na Dzień Wyceny t (dla dni kalendarzowych, w których stawka POLONIA nie jest publikowana, przyjmuje się stawkę z ostatniego dnia, w którym stawka była publikowana)
$r_{POLONIAt}$ – stopa zwrotu z POLONIA w okresie od Dnia Wyceny t-LD do Dnia Wyceny t”;

2) **w § 18b ust. 11**:
   a) **pkt 1** otrzymuje brzmienie:

„1) wyliczenie punktu odniesienia

$$BENCH_t = \prod_{n=1}^{t}(1 + r_{BENCHn})$$

$$r_{POLONIAt} = (1 + POLONIA_{t-1})^{\wedge(\frac{LD}{365})} - 1$$

$$r_{BENCHt} = 10\%\, r_{POLONIAt} + 90\%\frac{sWIG80TR_t - sWIG80TR_{t-1}}{sWIG80TR_{t-1}}$$

b) **w części** „***Definicje***" **wyrazy**:

„WIBOR ON$_t$ – stawka oprocentowania pożyczek overnight na rynku międzybankowym na Dzień Wyceny t (dla dni kalendarzowych, w których stawka WIBOR ON nie jest publikowana, przyjmuje się stawkę z ostatniego dnia, w którym stawka była publikowana)

$r_{WIBOR\ ONt}$ – stopa zwrotu z WIBOR ON w okresie od Dnia Wyceny t-LD do Dnia Wyceny t"

zastępuje się wyrazami:

„POLONIA$_t$ – stawka procentowa ustalana przez NBP jako średnia rentowność transakcji niezabezpieczonych, zawartych pomiędzy bankami biorącymi udział w fixingu, do godziny 16.30 w danym dniu roboczym, polegająca na przyjęciu lub złożeniu środków pieniężnych w PLN na termin overnight, ważona kwotami tych transakcji (symbol Bloomberg: PZCFPLNI Index) publikowana na Dzień Wyceny t (dla dni kalendarzowych, w których stawka POLONIA nie jest publikowana, przyjmuje się stawkę z ostatniego dnia, w którym stawka była publikowana)

$r_{POLONIAt}$ – stopa zwrotu z POLONIA w okresie od Dnia Wyceny t-LD do Dnia Wyceny t";

3) **w § 18d ust. 11**:

a) **pkt 1** otrzymuje brzmienie:

„1) wyliczenie punktu odniesienia

$$BENCH_t = \prod_{n=1}^{t}(1 + r_{BENCHn})$$

$$r_{POLONIAt} = (1 + POLONIA_{t-1})^{\wedge(\frac{LD}{365})} - 1$$

$$r_{BENCHt} = 10\%\, r_{POLONIAt} + 45\%\frac{WIG_t - WIG_{t-1}}{WIG_{t-1}} + 45\%\frac{CECE\ Net\ TR_{\ t} - CECE\ Net\ TR_{\ t-1}}{CECE\ Net\ TR_{\ t-1}}$$

b) **w części** „***Definicje***" **wyrazy**:

„WIBOR ON$_t$ – stawka oprocentowania pożyczek overnight na rynku międzybankowym na Dzień Wyceny t (dla dni kalendarzowych, w których stawka WIBOR ON nie jest publikowana, przyjmuje się stawkę z ostatniego dnia, w którym stawka była publikowana)

$r_{WIBOR\ ONt}$ – stopa zwrotu z WIBOR ON w okresie od Dnia Wyceny t-LD do Dnia Wyceny t"

zastępuje się wyrazami:

„POLONIA$_t$ – stawka procentowa ustalana przez NBP jako średnia rentowność transakcji niezabezpieczonych, zawartych pomiędzy bankami biorącymi udział w fixingu, do godziny 16.30 w danym dniu roboczym, polegająca na przyjęciu lub złożeniu środków pieniężnych w PLN na termin overnight, ważona kwotami tych transakcji (symbol Bloomberg: PZCFPLNI Index) publikowana na Dzień Wyceny t (dla dni kalendarzowych, w których stawka POLONIA nie jest publikowana, przyjmuje się stawkę z ostatniego dnia, w którym stawka była publikowana)

$r_{POLONIAt}$ – stopa zwrotu z POLONIA w okresie od Dnia Wyceny t-LD do Dnia Wyceny t";

4) **w § 18e ust. 11**:

a) **pkt 1** otrzymuje brzmienie:

„1) wyliczenie punktu odniesienia

$$BENCH_t = \prod_{n=1}^{t}(1 + r_{BENCHn})$$

$$r_{POLONIAt} = (1 + POLONIA_{t-1})^{\wedge(\frac{LD}{365})} - 1$$

$$r_{BENCHt} = 10\%\, r_{POLONIAt} + 90\% \frac{WIG_t - WIG_{t-1}}{WIG_{t-1}}$$

b) **w części** „***Definicje***" **wyrazy**:

„WIBOR ON$_t$ – stawka oprocentowania pożyczek overnight na rynku międzybankowym na Dzień Wyceny t (dla dni kalendarzowych, w których stawka WIBOR ON nie jest publikowana, przyjmuje się stawkę z ostatniego dnia, w którym stawka była publikowana)

r$_{WIBOR\ ONt}$ – stopa zwrotu z WIBOR ON w okresie od Dnia Wyceny t-LD do Dnia Wyceny t"

zastępuje się wyrazami:

„POLONIA$_t$ – stawka procentowa ustalana przez NBP jako średnia rentowność transakcji niezabezpieczonych, zawartych pomiędzy bankami biorącymi udział w fixingu, do godziny 16.30 w danym dniu roboczym, polegająca na przyjęciu lub złożeniu środków pieniężnych w PLN na termin overnight, ważona kwotami tych transakcji (symbol Bloomberg: PZCFPLNI Index) publikowana na Dzień Wyceny t (dla dni kalendarzowych, w których stawka POLONIA nie jest publikowana, przyjmuje się stawkę z ostatniego dnia, w którym stawka była publikowana)

r$_{POLONIAt}$ – stopa zwrotu z POLONIA w okresie od Dnia Wyceny t-LD do Dnia Wyceny t";

5) **w § 18g ust. 11**:

a) **pkt 1** otrzymuje brzmienie:

„1) wyliczenie punktu odniesienia

$$BENCH_t = \prod_{n=1}^{t}(1 + r_{BENCHn})$$

$$r_{POLONIAt} = (1 + POLONIA_{t-1})^{\wedge(\frac{LD}{365})} - 1$$

$$r_{BENCHt} = 10\%\, r_{POLONIAt} + 90\% \frac{MSCI\ Daily\ TR\ Net\ USA_{\ t} - MSCI\ Daily\ TR\ Net\ USA_{\ t-1}}{MSCI\ Daily\ TR\ Net\ USA_{\ t-1}}$$

b) **w części** „***Definicje***" **wyrazy**:

„WIBOR ON$_t$ – stawka oprocentowania pożyczek overnight na rynku międzybankowym na Dzień Wyceny t (dla dni kalendarzowych, w których stawka WIBOR ON nie jest publikowana, przyjmuje się stawkę z ostatniego dnia, w którym stawka była publikowana)

r$_{WIBOR\ ONt}$ – stopa zwrotu z WIBOR ON w okresie od Dnia Wyceny t-LD do Dnia Wyceny t"

zastępuje się wyrazami:

„POLONIA$_t$ – stawka procentowa ustalana przez NBP jako średnia rentowność transakcji niezabezpieczonych, zawartych pomiędzy bankami biorącymi udział w fixingu, do godziny 16.30 w danym dniu roboczym, polegająca na przyjęciu lub złożeniu środków pieniężnych w PLN na termin overnight, ważona kwotami tych transakcji (symbol Bloomberg: PZCFPLNI Index) publikowana na Dzień Wyceny t (dla dni kalendarzowych, w których stawka POLONIA nie jest publikowana, przyjmuje się stawkę z ostatniego dnia, w którym stawka była publikowana)

r$_{POLONIAt}$ – stopa zwrotu z POLONIA w okresie od Dnia Wyceny t-LD do Dnia Wyceny t";

6) **w § 18i ust. 11**:

a) **pkt 1** otrzymuje brzmienie:

„1) wyliczenie punktu odniesienia

$$BENCH_t = \prod_{n=1}^{t}(1 + r_{BENCHn})$$

$$r_{POLONIAt} = (1 + POLONIA_{t-1})^{\wedge(\frac{LD}{365})} - 1$$

$$r_{BENCHt} = 10\%\, r_{POLONIAt} + 90\%\frac{MSCI\ World\ TR_t - MSCI\ World\ TR_{t-1}}{MSCI\ World\ TR_{t-1}}$$

b) **w części** „***Definicje***" **wyrazy**:

„WIBOR ON$_t$ – stawka oprocentowania pożyczek overnight na rynku międzybankowym na Dzień Wyceny t (dla dni kalendarzowych, w których stawka WIBOR ON nie jest publikowana, przyjmuje się stawkę z ostatniego dnia, w którym stawka była publikowana)

$r_{WIBOR\ ONt}$ – stopa zwrotu z WIBOR ON w okresie od Dnia Wyceny t-LD do Dnia Wyceny t"

zastępuje się wyrazami:

„POLONIA$_t$ – stawka procentowa ustalana przez NBP jako średnia rentowność transakcji niezabezpieczonych, zawartych pomiędzy bankami biorącymi udział w fixingu, do godziny 16.30 w danym dniu roboczym, polegająca na przyjęciu lub złożeniu środków pieniężnych w PLN na termin overnight, ważona kwotami tych transakcji (symbol Bloomberg: PZCFPLNI Index) publikowana na Dzień Wyceny t (dla dni kalendarzowych, w których stawka POLONIA nie jest publikowana, przyjmuje się stawkę z ostatniego dnia, w którym stawka była publikowana)

$r_{POLONIAt}$ – stopa zwrotu z POLONIA w okresie od Dnia Wyceny t-LD do Dnia Wyceny t";

7) **w § 18j ust. 11**:

a) **pkt 1** otrzymuje brzmienie:

„1) wyliczenie punktu odniesienia

$$BENCH_t = \prod_{n=1}^{t}(1 + r_{BENCHn})$$

$$r_{POLONIAt} = (1 + POLONIA_{t-1})^{\wedge(\frac{LD}{365})} - 1$$

$$r_{BENCHt} = 10\%\, r_{POLONIAt} + 90\%\frac{MSCI\ Emerging\ Markets\ TR_t - MSCI\ Emerging\ Markets\ TR_{t-1}}{MSCI\ Emerging\ Markets\ TR_{t-1}}$$

b) **w części** „***Definicje***" **wyrazy**:

„WIBOR ON$_t$ – stawka oprocentowania pożyczek overnight na rynku międzybankowym na Dzień Wyceny t (dla dni kalendarzowych, w których stawka WIBOR ON nie jest publikowana, przyjmuje się stawkę z ostatniego dnia, w którym stawka była publikowana)

$r_{WIBOR\ ONt}$ – stopa zwrotu z WIBOR ON w okresie od Dnia Wyceny t-LD do Dnia Wyceny t"

zastępuje się wyrazami:

„POLONIA$_t$ – stawka procentowa ustalana przez NBP jako średnia rentowność transakcji niezabezpieczonych, zawartych pomiędzy bankami biorącymi udział w fixingu, do godziny 16.30 w danym dniu roboczym, polegająca na przyjęciu lub złożeniu środków pieniężnych w PLN na termin

overnight, ważona kwotami tych transakcji (symbol Bloomberg: PZCFPLNI Index) publikowana na Dzień Wyceny t (dla dni kalendarzowych, w których stawka POLONIA nie jest publikowana, przyjmuje się stawkę z ostatniego dnia, w którym stawka była publikowana)
$r_{POLONIAt}$ – stopa zwrotu z POLONIA w okresie od Dnia Wyceny t-LD do Dnia Wyceny t";

8) **w § 18k ust. 11**:
a) **pkt 1** otrzymuje brzmienie:
„1) wyliczenie punktu odniesienia

$$BENCH_t = \prod_{n=1}^{t}(1 + r_{BENCHn})$$

$$r_{POLONIAt} = (1 + POLONIA_{t-1})^{\wedge(\frac{LD}{365})} - 1$$

$$r_{BENCHt} = 10\%\, r_{POLONIAt} + 90\% \frac{MSCI\ Emerging\ Asia\ Net\ TR_t - MSCI\ Emerging\ Asia\ Net\ TR_{t-1}}{MSCI\ Emerging\ Asia\ Net\ TR_{t-1}}$$

b) **w części „*Definicje*" wyrazy**:
„WIBOR ON_t – stawka oprocentowania pożyczek overnight na rynku międzybankowym na Dzień Wyceny t (dla dni kalendarzowych, w których stawka WIBOR ON nie jest publikowana, przyjmuje się stawkę z ostatniego dnia, w którym stawka była publikowana)
$r_{WIBOR\ ONt}$ – stopa zwrotu z WIBOR ON w okresie od Dnia Wyceny t-LD do Dnia Wyceny t"
zastępuje się wyrazami:
„$POLONIA_t$ – stawka procentowa ustalana przez NBP jako średnia rentowność transakcji niezabezpieczonych, zawartych pomiędzy bankami biorącymi udział w fixingu, do godziny 16.30 w danym dniu roboczym, polegająca na przyjęciu lub złożeniu środków pieniężnych w PLN na termin overnight, ważona kwotami tych transakcji (symbol Bloomberg: PZCFPLNI Index) publikowana na Dzień Wyceny t (dla dni kalendarzowych, w których stawka POLONIA nie jest publikowana, przyjmuje się stawkę z ostatniego dnia, w którym stawka była publikowana)
$r_{POLONIAt}$ – stopa zwrotu z POLONIA w okresie od Dnia Wyceny t-LD do Dnia Wyceny t".

Wskazane powyżej zmiany Statutu Funduszu wchodzą w życie z dniem ogłoszenia, tj. w dniu 1 października 2026 r.

Na dokonanie wskazanych powyżej zmian oraz na skrócenie terminu wejścia ich w życie, Komisja Nadzoru Finansowego udzieliła zezwolenia decyzją z dnia 25 maja 2026 r. (nr DFF.4022.1.47.2026.AW).