INFORMACJA DLA KLIENTA ALTERNATYWNEGO FUNDUSZU INWESTYCYJNEGO

ROCKBRIDGE FUNDUSZ INWESTYCYJNY ZAMKNIĘTY BEZPIECZNA INWESTYCJA 6

sporządzona na dzień 30 czerwca 2018 r. za okres sprawozdawczy pierwszego półrocza 2018 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")

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

Aktualny profil ryzyka określono na 2 w siedmiostopniowej skali i stanowi on ogólny wskaźnik ryzyka i zysku ustalany zgodnie z metodologią określoną dla danych przedstawianych w Dokumencie Zawierającym Kluczowe Informacje o Funduszu (KIID).

Towarzystwo identyfikuje i stosuje limity inwestycyjne dla w szczególności następujących ryzyk:

1) ryzyko rynkowe (limity dla każdego czynnika ryzyka);
2) ryzyko kredytowe i kontrahenta;
3) ryzyko płynności

odpowiednio do stosowanej przez Fundusz polityki inwestycyjnej i zgodnie z metodykami określonymi w wewnętrznych procedurach.

Ryzyko operacyjne zarządzane jest globalnie na poziomie procesowym.

Globalny poziom ryzyka określany jest przez ekspozycję AFI zgodnie z zapisami Rozporządzenia 231/2013. Limit ekspozycji AFI wyznaczonej metodą zaangażowania wynosi 400% WAN Funduszu.

Łącznej wysokości zastosowanej dźwigni finansowej AFI na dzień bilansowy

Wysokość dźwigni finansowej zastosowanej przez Fundusz obliczanej jako iloraz ekspozycji AFI i Wartości Aktywów Netto Funduszu wynosił na dzień 30 czerwca 2018:

metoda zaangażowania: 107,62%

metoda brutto: 105,84%