

skorygowany

KOMISJA NADZORU FINANSOWEGO

Raport kwartalny FIZ-Q-E

za 3 kwartał 2017 roku obejmujący okres od 2017-07-01 do 2017-09-30

podstawa prawna:

§ 82 ust. 1 pkt 1 Rozporządzenia Ministra Finansów z dnia 19 lutego 2009 r. w sprawie informacji bieżących i okresowych przekazywanych przez emitentów papierów wartościowych oraz warunków uznawania za równoważne informacji wymaganych przepisami prawa państwa niebędącego państwem członkowskim (Dz. U. nr 33, poz. 259 z późn. zm.)

Data przekazania: 2017-11-03

ROCKBRIDGE FUNDUSZ INWESTYCYJNY ZAMKNIĘTY BEZPIECZNA INWESTYCJA 2		
(pełna nazwa funduszu)		
ROCKBRIDGE FIZ BEZPIECZNA INWESTYCJA 2	ROCKBRIDGE TOWARZYSTWO FUNDUSZY INWESTYCYJNYCH S.A.	
(skrótowa nazwa funduszu)	(nazwa towarzystwa)	
00-203	Warszawa	
(kod pocztowy)	(miejsowość)	
BONIFRATERSKA		17
(ulica)		(numer)
(0-22) 538 97 77	(0-22) 538 97 98	info@rockbridge.pl
(telefon)	(fax)	(e-mail)
107-00-02-105	140045669	www.rockbridge.pl
(NIP)	(REGON)	(WWW)

KOMISJA NADZORU FINANSOWEGO

Informacje o funduszu

Konstrukcja funduszu:	Typ funduszu:
Subfundusz: <input type="checkbox"/>	Fundusz sekurytyzacyjny: <input type="checkbox"/>
Fundusz podstawowy: <input type="checkbox"/>	Fundusz portfelowy: <input type="checkbox"/>
Fundusz powiązany: <input type="checkbox"/>	Fundusz aktywów niepublicznych: <input type="checkbox"/>
	Waluta sprawozdania finansowego: zł

Fundusze powiązane:	(nazwa funduszu podstawowego)
Fundusz z wydzielonymi subfunduszami:	(nazwy funduszy powiązanych)
	(nazwa funduszu)

Plik	Opis
BI2 09_2017 WPROWADZENIE.rtf	

WYBRANE DANE FINANSOWE	w tys. zł.	w tys. EUR
I. Przychody z lokat	65	15
II. Koszty funduszu netto	81	19
III. Przychody z lokat netto	-16	-4
IV. Zrealizowane zyski (straty) ze zbycia lokat	-74	-17
V. Niezrealizowane zyski (straty) z wyceny lokat	175	41
VI. Wynik z operacji	86	20
VII. Zobowiązania	25	6
VIII. Aktywa	13 782	3 198
IX. Aktywa netto	13 757	3 193
X. Liczba zarejestrowanych certyfikatów inwestycyjnych	92 361	92 361
XI. Wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny	148,95	34,57
XII. Wynik z operacji na certyfikat inwestycyjny	0,93	0,22
pozycja X. wykazana w szt.		
pozycje XI i XII odpowiednio: w zł. i EUR		
pozycje bilansu w tys. EUR są przeliczone wg. średniego kursu NBP z dnia 29 września 2017 r.		
pozycje rachunku wyników w tys. EUR są przeliczone wg. średniej arytmetycznej kursów NBP z dnia 31 lipca, 31 sierpnia i 29 września 2017 r.		

ZESTAWIENIE LOKAT

SKŁADNIKI LOKAT	3 kwartał			2 kwartał			2016
	2017 roku			2017 roku			
	Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem	Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem	
1. Akcje	1 526	1 740	12,62	1 518	1 639	11,29	1 536
2. Warranty subskrypcyjne	0	0	0,00	0	0	0,00	0
3. Prawa do akcji	0	0	0,00	0	0	0,00	0
4. Prawa poboru	0	0	0,00	0	0	0,00	0
5. Kwity depozytowe	0	0	0,00	0	0	0,00	0
6. Listy zastawne	0	0	0,00	0	0	0,00	0
7. Dłużne papiery wartościowe	11 203	11 407	82,77	11 718	11 826	81,44	14 508
8. Instrumenty pochodne	0	0	0,00	0	0	0,00	0
9. Udziały w spółkach z ograniczoną odpowiedzialnością	0	0	0,00	0	0	0,00	0
10. Jednostki uczestnictwa	0	0	0,00	0	0	0,00	0
11. Certyfikaty inwestycyjne	0	0	0,00	0	0	0,00	0
12. Tytuły uczestnictwa emitowane przez instytucje w wspólnego inwestowania mające siedzibę za granicą	0	0	0,00	0	0	0,00	0
13. Wierzytelności	0	0	0,00	0	0	0,00	0
14. Weksle	0	0	0,00	0	0	0,00	0
15. Depozyty	0	0	0,00	0	0	0,00	0
16. Waluty	0	0	0,00	0	0	0,00	0
17. Nieruchomości	0	0	0,00	0	0	0,00	0
18. Statki morskie	0	0	0,00	0	0	0,00	0
19. Inne	0	0	0,00	0	0	0,00	0
Fundusz zaprzestał prezentowania niezrealizowanego zysku z wyceny kontraktów terminowych w tabeli głównej i tabeli uzupełniającej. Niezrealizowany zysk lub strata z wyceny kontraktów terminowych jest prezentowany w bilansie w pozycji "środki pieniężne". Rozliczenia z tytułu kontraktów terminowych są dokonywane codziennie.							
Dłużne papiery wartościowe prezentowane są łącznie z odsetkami.							
Fundusz nie prezentuje depozytów overnight jako składnika lokat.							

TABELE/ZUPEŁNIAJĄCE

rok	3 kwartał				
	2016 roku				
	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem	Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
	1 400	8,46	1 536	1 227	7,05
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	14 491	87,58	15 251	14 864	85,48
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00
	0	0,00	0	0	0,00

AKCJE	Rodzaj rynku	Nazwa rynku	Liczba	Kraj siedziby emitenta	Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.
1. Alior Bank S.A. (PLALIOR00045)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie	707	RZECZPOSPOLITA POLSKA	45	48
2. ASSECO POLAND S.A. (PLSOFTB00016)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie	574	RZECZPOSPOLITA POLSKA	25	27
3. Bank Polska Kasa Opieki S.A. (PLPEKAO00016)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie	1 211	RZECZPOSPOLITA POLSKA	193	155
4. Bank Zachodni WBK S.A. (PLBZ00000044)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie	231	RZECZPOSPOLITA POLSKA	66	81
5. CCC S.A. (PLCCC0000016)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie	203	RZECZPOSPOLITA POLSKA	31	56
6. CYFROWY POLSAT S.A. (PLCFRPT00013)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie	1 652	RZECZPOSPOLITA POLSKA	42	43
7. ENERGA S.A. (PLENERG00022)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie	1 547	RZECZPOSPOLITA POLSKA	41	21
8. EUROCASH S.A. (PLEURCH00011)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie	602	RZECZPOSPOLITA POLSKA	24	23
9. Grupa Lotos S.A. (PLLOTOS00025)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie	665	RZECZPOSPOLITA POLSKA	25	40
10. JASTRZĘBSKA SPÓŁKA WĘGLOWA S.A. (PLJSW0000015)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie	406	RZECZPOSPOLITA POLSKA	42	39
11. KGHM Polska Miedź S.A. (PLKGHM000017)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie	1 050	RZECZPOSPOLITA POLSKA	114	123
12. LPP S.A. (PLLPP0000011)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie	14	RZECZPOSPOLITA POLSKA	103	114
13. mBank S.A. (PLBRE0000012)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie	98	RZECZPOSPOLITA POLSKA	34	41
14. Orange Polska S.A. (PLTLKPL00017)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie	4 991	RZECZPOSPOLITA POLSKA	34	26
15. PGE Polska Grupa Energetyczna S.A. (PLPGER000010)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie	6 139	RZECZPOSPOLITA POLSKA	109	82
16. Polski Koncern Naftowy ORLEN S.A. (PLPKN0000018)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie	2 219	RZECZPOSPOLITA POLSKA	96	270
17. Polskie Górnictwo Naftowe i Gazownictwo S.A. (PLPGNIG00014)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie	12 523	RZECZPOSPOLITA POLSKA	56	85
18. Powszechna Kasa Oszczędności Bank Polski S.A. (PLPKO0000016)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie	6 608	RZECZPOSPOLITA POLSKA	226	233
19. Powszechny Zakład Ubezpieczeń S.A. (PLPZU0000011)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie	4 382	RZECZPOSPOLITA POLSKA	183	202
20. TAURON Polska Energia S.A. (PLTAURN00011)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie	8 043	RZECZPOSPOLITA POLSKA	37	30

DŁUŻNE PAPIERY WARTOŚCIOWE	Rodzaj rynku	Nazwa rynku	Emitent	Kraj siedziby emitenta	Termin wykupu	Warunki oprocentowania
1. O terminie wykupu powyżej 1 roku:						
a) Obligacje						
- PS0420 (PL0000108510)	Aktywny rynek - rynek regulowany	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie	SKARB PAŃSTWA POLSKI	RZECZPOSPOLITA POLSKA	2020-04-25	stałe 1,50

INSTRUMENTY POCHODNE	Rodzaj rynku	Nazwa rynku	Emitent (wystawca)	Kraj siedziby emitenta (wystawcy)	Instrument bazowy	Liczba

Procentowy udział w aktywach ogółem
0,35
0,19
1,12
0,59
0,41
0,31
0,15
0,17
0,29
0,28
0,89
0,83
0,30
0,19
0,59
1,96
0,62
1,69
1,46
0,22

Wartość nominalna	Liczba	Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
	11 473	11 203	11 407	82,77
	11 473	11 203	11 407	82,77
1 000,00	11 473	11 203	11 407	82,77

Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem

I. Wystandaryzowane instrumenty pochodne:						34
1. FUTURES, Indeks WIG20, FW20Z1720, 2017-12-15 (PLOGF0012302) - pozycja krótka	Aktywny rynek - rynek regulowany	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie	Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie S.A.	RZECZPOSPOLI TA POLSKA	Indeks WIG20	34

NIERUCHOMOŚCI	Rok oddania do użytku	Data nabycia	Numer księgi wieczystej	Kraj położenia	Adres	Powierzchnia	Obciążenia
----------------------	--------------------------	--------------	----------------------------	----------------	-------	--------------	------------

TABEL DODATKOWE

GWARANTOWANE SKŁADNIKI LOKAT	Rodzaj	Łączna liczba	Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
1. Papiery wartościowe gwarantowane przez Skarb Państwa	nie dotyczy				
2. Papiery wartościowe gwarantowane przez NBP	nie dotyczy				
3. Papiery wartościowe gwarantowane przez jednostki samorządu terytorialnego	nie dotyczy				
4. Papiery wartościowe gwarantowane przez państwa należące do OECD (z wyłączeniem Rzeczypospolitej Polskiej)	nie dotyczy				
5. Papiery wartościowe gwarantowane przez międzynarodowe instytucje finansowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska lub przynajmniej jedno z państw należących do OECD	nie dotyczy				

INSTRUMENTY RYNKU PIENIĘŻNEGO	Emitent	Termin wykupu	Warunki oprocentowania	Wartość nominalna	Liczba	Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.
1. nie dotyczy							

GRUPY KAPITAŁOWE, O KTÓRYCH MOWA W ART. 98 USTAWY	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
1. GRUPA PZU	250	1,81

SKŁADNIKI LOKAT NABYTE OD PODMIOTÓW, O KTÓRYCH MOWA W ART. 107 USTAWY	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem
1. nie dotyczy		

PAPIERY WARTOŚCIOWE EMITOWANE PRZEZ MIĘDZYNARODOWE INSTYTUCJE FINANSOWE, KTÓRYCH CZŁONKIEM JEST RZECZPOSPOLITA POLSKA LUB PRZYNAJMNIEJ JEDNO Z PAŃSTW NALEŻĄCYCH DO OECD	Nazwa emitenta	Kraj siedziby emitenta	Rodzaj rynku	Nazwa rynku	Liczba	Wartość według ceny nabycia w tys.
1. nie dotyczy						

0	0	0,00
0	0	0,00

Służebności	Wartość według ceny nabycia w tys.	Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem

Procentowy udział w aktywach ogółem

Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys.	Procentowy udział w aktywach ogółem

BILANS	3 kwartał		2 kwartał		2016 rok	3 kwartał 2016 roku
	2017	roku	2017	roku		
I. Aktywa	13 782		14 522		16 546	17 389
1. Środki pieniężne i ich ekwiwalenty	620		1 033		654	978
2. Należności	7		11		1	312
3. Transakcje przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu	0		0		0	0
4. Składniki lokat notowane na aktywnym rynku, w tym:	13 147		13 465		15 891	16 091
- dłużne papiery wartościowe	11 407		11 826		14 491	14 864
5. Składniki lokat nienotowane na aktywnym rynku, w tym:	0		0		0	0
- dłużne papiery wartościowe	0		0		0	0
6. Nieruchomości	0		0		0	0
7. Pozostałe aktywa	8		14		0	8
II. Zobowiązania	25		28		30	32
III. Aktywa netto (I-II)	13 757		14 494		16 516	17 357
IV. Kapitał funduszu	-33 242		-32 419		-30 307	-29 436
1. Kapitał wpłacony	142 499		142 499		142 499	142 499
2. Kapitał wypłacony (wielkość ujemna)	-175 741		-174 918		-172 806	-171 935
V. Dochody zatrzymane	46 623		46 712		47 437	47 486
1. Zakumulowane, nierozdysponowane przychody z lokat netto	19 374		19 390		19 344	19 267
2. Zakumulowany, nierozdysponowany zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	27 248		27 322		28 094	28 219
VI. Wzrost (spadek) wartości lokat w odniesieniu do ceny nabycia	376		201		-614	-693
VII. Kapitał funduszu i zakumulowany wynik z operacji (IV+V+/-VI)	13 757		14 494		16 516	17 357

Liczba zarejestrowanych certyfikatów inwestycyjnych	92 361	97 918	112 276	118 207
Wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny	148,95	148,02	147,10	146,84

Przewidywana liczba certyfikatów inwestycyjnych	89 865
Rozwodniona wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny	148,95

Liczba certyfikatów inwestycyjnych w podziale na serie certyfikatów:
Liczba certyfikatów inwestycyjnych serii A: 92 361 szt.

Wartość aktywów netto na poszczególne serie certyfikatów inwestycyjnych:
Wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny serii A: 148,95 zł.
Dłużne papiery wartościowe prezentowane są łącznie z odsetkami.
Fundusz prezentuje lokaty overnight w pozycji "środki pieniężne".
Niezrealizowany zysk lub strata z wyceny kontraktów terminowych jest prezentowany w pozycji "środki pieniężne".

Narastająco
kwartały roku
bieżącego
kwartał:
rok:
od:
do:

Okres roku
poprzedniego
od:
do:

Narastająco
kwartały roku
poprzedniego
kwartał:
rok:
od:
do:

RACHUNEK WYNIKU Z OPERACJI	od 2017-07-01	3 2017	2016-07-01	3 2016
	do 2017-09-30	2017-01-01 2017-09-30	2016-09-30	2016-01-01 2016-09-30
I. Przychody z lokat	65	285	199	592
1. Dywidendy i inne udziały w zyskach	20	34	21	38
2. Przychody odsetkowe	46	251	178	554
3. Przychody związane z posiadaniem nieruchomości	0	0	0	0
4. Dodatnie saldo różnic kursowych	0	0	0	0
5. Pozostałe	0	0	0	0
II. Koszty funduszu	81	255	101	317
1. Wynagrodzenie dla towarzystwa	71	223	88	284
2. Wynagrodzenia dla podmiotów prowadzących dystrybucję	0	0	0	0
3. Opłaty dla depozytariusza	2	6	2	6
4. Opłaty związane z prowadzeniem rejestru aktywów funduszu	4	13	5	14
5. Opłaty za zezwolenia oraz rejestracyjne	0	0	0	0
6. Usługi w zakresie rachunkowości	0	0	0	0
7. Usługi w zakresie zarządzania aktywami funduszu	0	0	0	0
8. Usługi prawne	0	0	0	0
9. Usługi wydawnicze, w tym poligraficzne	0	0	0	0
10. Koszty odsetkowe	0	0	0	0
11. Koszty związane z posiadaniem nieruchomości	0	0	0	0
12. Ujemne saldo różnic kursowych	0	0	0	0
13. Pozostałe	4	12	6	13
III. Koszty pokrywane przez towarzystwo	0	0	0	0
IV. Koszty funduszu netto (II-III)	81	255	101	317
V. Przychody z lokat netto (I-IV)	-16	31	99	275
VI. Zrealizowany i niezrealizowany zysk (strata)	102	146	-134	-435
1. Zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat, w tym:	-74	-845	5	-74
- z tytułu różnic kursowych	0	0	0	0
2. Wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat, w tym:	175	991	-139	-361
- z tytułu różnic kursowych	0	0	0	0
VII. Wynik z operacji	86	176	-36	-160

Wynik z operacji przypadający na certyfikat inwestycyjny	0,93	1,91	-0,30	-1,35
Rozwodniony wynik z operacji przypadający na certyfikat inwestycyjny	0,93	1,91	-0,30	-1,35

Narastająco
kwartały roku
bieżącego
kwartał:
rok:
od:
do:

Okres roku
poprzedniego
od:
do:

Narastająco
kwartały roku
poprzedniego
kwartał:
rok:
od:
do:

ZESTAWIENIE ZMIAN W AKTYWACH NETTO	od 2017-07-01	3 2017	2016-01-01	3 2016
	do 2017-09-30	2017-01-01 2017-09-30	2016-09-30	2016-01-01 2016-09-30
I. Zmiana wartości aktywów netto	-737	-2 758	-4 687	-3 845
1. Wartość aktywów netto na koniec poprzedniego okresu sprawozdawczego	14 494	16 516	21 202	21 202
2. Wynik z operacji za okres sprawozdawczy (razem), w tym:	86	176	-130	-160
a) przychody z lokat netto	-16	31	352	275
b) zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat	-74	-845	-200	-74
c) wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat	175	991	-283	-361
3. Zmiana w aktywach netto z tytułu wyniku z operacji	86	176	-130	-160
4. Dystrybucja dochodów (przychodów) funduszu (razem)	0	0	0	0
a) z przychodów z lokat netto	0	0	0	0
b) ze zrealizowanego zysku ze zbycia lokat	0	0	0	0
c) z przychodów ze zbycia lokat	0	0	0	0

5. Zmiany w kapitale w okresie sprawozdawczym (razem), w tym:	-823	-2 935	-4 556	-3 686
a) zmiana kapitału wpłaconego (powiększenie kapitału z tytułu wydanych certyfikatów inwestycyjnych)	0	0	0	0
b) zmiana kapitału wypłaconego (zmniejszenie kapitału z tytułu wykupionych certyfikatów inwestycyjnych)	-823	-2 935	-4 556	-3 686
6. Łączna zmiana aktywów netto w okresie sprawozdawczym	-737	-2 758	-4 687	-3 845
7. Wartość aktywów netto na koniec okresu sprawozdawczego	13 757	13 757	16 516	17 357
8. Średnia wartość aktywów netto w okresie sprawozdawczym	13 995	14 890	18 397	18 939
II. Zmiana liczby certyfikatów inwestycyjnych	5 557	19 915	30 834	24 903
1. Zmiana liczby certyfikatów inwestycyjnych w okresie sprawozdawczym:	5 557	19 915	30 834	24 903
a) liczba wydanych certyfikatów inwestycyjnych	0	0	0	0
b) liczba wykupionych certyfikatów inwestycyjnych	5 557	19 915	30 834	24 903
c) saldo zmian	-5 557	-19 915	-30 834	-24 903
2. Liczba certyfikatów inwestycyjnych narastająco od początku działalności funduszu, w tym:	92 361	92 361	112 276	118 207
a) liczba wydanych certyfikatów inwestycyjnych	1 424 991	1 424 991	1 424 991	1 424 991
b) liczba wykupionych certyfikatów inwestycyjnych	1 332 630	1 332 630	1 312 715	1 306 784
c) saldo zmian	92 361	92 361	112 276	118 207
3. Przewidywana liczba certyfikatów inwestycyjnych	89 865	89 865	105 857	112 276
III. Zmiana wartości aktywów netto na certyfikat inwestycyjny	0,93	1,85	-1,05	-1,31
1. wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny na koniec poprzedniego okresu sprawozdawczego	148,02	147,10	148,15	148,15
2. wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny na koniec bieżącego okresu sprawozdawczego	148,95	148,95	147,10	146,84
3. procentowa zmiana wartości aktywów netto na certyfikat inwestycyjny w okresie sprawozdawczym	0,63	1,26	-0,71	-0,88
4. minimalna wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny w okresie sprawozdawczym	148,63	147,10	146,84	146,84
- data wyceny	2017-07-31	2017-03-31	2016-09-30	2016-09-30
5. maksymalna wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny w okresie sprawozdawczym	149,20	149,20	148,15	148,15
- data wyceny	2017-08-31	2017-08-31	2016-03-31	2016-03-31
6. wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny według ostatniej wyceny w okresie sprawozdawczym	148,95	148,95	147,09	146,84
- data wyceny	2017-09-29	2017-09-29	2016-12-30	2016-09-30
7. Rozwodniona wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny	148,95	148,95	147,10	146,84
IV. Procentowy udział kosztów funduszu w średniej wartości aktywów netto, w tym:	0,58	1,71	2,24	1,67
1. procentowy udział wynagrodzenia dla towarzystwa	0,50	1,50	2,00	1,50
2. procentowy udział wynagrodzenia dla podmiotów prowadzących dystrybucję	0,00	0,00	0,00	0,00
3. procentowy udział opłat dla depozytariusza	0,02	0,04	0,04	0,03
4. procentowy udział opłat związanych z prowadzeniem rejestru aktywów funduszu	0,03	0,09	0,10	0,07
5. procentowy udział opłat za usługi w zakresie rachunkowości	0,00	0,00	0,00	0,00
6. procentowy udział opłat za usługi w zakresie zarządzania aktywami funduszu	0,00	0,00	0,00	0,00

Narastająco
kwartaly roku
bieżącego
kwartał:
rok:
od:
do:

Okres roku
poprzedniego
od:
do:

Narastająco
kwartaly roku
poprzedniego
kwartał:
rok:
od:
do:

RACHUNEK PRZEPIŃYWÓW PIENIĘŻNYCH	od 2017-07-01	3 2017	2016-07-01	3 2016
	do 2017-09-30	2017-01-01 2017-09-30	2016-09-30	2016-01-01 2016-09-30
A. Przepływy środków pieniężnych z działalności operacyjnej	410	2 901	-65	2 787
I. Wpływy	936	16 145	238	3 970
1. Z tytułu posiadanych lokat	23	219	20	719
2. Z tytułu zbycia składników lokat	911	15 919	215	3 233
3. Pozostałe	2	7	3	17
a) w tym odsetki od lokat i rachunków bankowych	2	7	3	9
II. Wydatki	526	13 245	302	1 183
1. Z tytułu posiadanych lokat	0	0	0	0
2. Z tytułu nabycia składników lokat	448	12 977	208	852
3. Z tytułu wypłaconego wynagrodzenia dla towarzystwa	72	228	89	291
4. Z tytułu wypłaconego wynagrodzenia dla podmiotów prowadzących dystrybucję	0	0	0	0
5. Z tytułu opłat dla depozytariusza	2	6	2	5
6. Z tytułu opłat związanych z prowadzeniem rejestru aktywów funduszu	0	17	0	19

7. Z tytułu opłat za zezwolenia oraz opłat rejestracyjnych	0	0	0	0
8. Z tytułu usług w zakresie rachunkowości	0	0	0	0
9. Z tytułu usług w zakresie zarządzania aktywami funduszu	0	0	0	0
10. Z tytułu usług prawnych	0	0	0	0
11. Z tytułu posiadania nieruchomości	0	0	0	0
12. Pozostałe	4	16	4	16
B. Przepływy środków pieniężnych z działalności finansowej	-823	-2 935	-554	-3 686
I. Wpływy	0	0	0	0
1. Z tytułu wydania certyfikatów inwestycyjnych	0	0	0	0
2. Z tytułu zaciągniętych kredytów	0	0	0	0
3. Z tytułu zaciągniętych pożyczek	0	0	0	0
4. Z tytułu spłaty udzielonych pożyczek	0	0	0	0
5. Odsetki	0	0	0	0
6. Pozostałe	0	0	0	0
II. Wydatki	823	2 935	554	3 686
1. Z tytułu wykupienia certyfikatów inwestycyjnych	823	2 935	554	3 686
2. Z tytułu spłat zaciągniętych kredytów	0	0	0	0
3. Z tytułu spłat zaciągniętych pożyczek	0	0	0	0
4. Z tytułu wyemitowanych obligacji	0	0	0	0
5. Z tytułu wypłaty przychodów	0	0	0	0
6. Z tytułu udzielonych pożyczek	0	0	0	0
7. Odsetki	0	0	0	0
8. Pozostałe	0	0	0	0
C. Skutki zmian kursów wymiany środków pieniężnych i ekwiwalentów środków pieniężnych	0	0	0	0
D. Zmiana stanu środków pieniężnych netto (A+/-B)	-412	-34	-619	-899
E. Środki pieniężne i ekwiwalenty środków pieniężnych na początek okresu sprawozdawczego	1 033	654	1 597	1 877
F. Środki pieniężne i ekwiwalenty środków pieniężnych na koniec okresu sprawozdawczego (E+/-D)	620	620	978	978

NOTY

NOTA-1POLITYKARACHUNKOWOŚCI

Plik	Opis
Nota 1RB FIZ_BI2.rtf	

NOTA-2NALEŻNOŚCIFUNDUSZU	3 kwartał
	2017 roku
1. Z tytułu zbytych lokat	0
2. Z tytułu instrumentów pochodnych	0
3. Z tytułu wydanych certyfikatów inwestycyjnych	0
4. Z tytułu dywidendy	7
5. Z tytułu odsetek	0
6. Z tytułu posiadanych nieruchomości, w tym czynszów	0
7. Z tytułu udzielonych pożyczek	0
8. Pozostałe	0

NOTA-3ZOBOWIĄZANIA FUNDUSZU	3 kwartał
	2017 roku
1. Z tytułu nabytych aktywów	0
2. Z tytułu transakcji przy zobowiązaniu się funduszu do odkupu	0
3. Z tytułu instrumentów pochodnych	0
4. Z tytułu wpłat na certyfikaty inwestycyjne	0
5. Z tytułu wykupionych certyfikatów inwestycyjnych	0
6. Z tytułu wypłaty dochodów funduszu	0
7. Z tytułu wypłaty przychodów funduszu	0

8. Z tytułu wyemitowanych obligacji	0
9. Z tytułu krótkoterminowych pożyczek i kredytów	0
10. Z tytułu długoterminowych pożyczek i kredytów	0
11. Z tytułu gwarancji lub poręczeń	0
12. Z tytułu rezerw	25
13. Pozostałe zobowiązania	0

INFORMACJA DODATKOWA

Plik	Opis
FBI2_raport_III_kwartal_2017_dodatkowa.rtf	

PODPISY

PODPISY OSÓB REPREZENTUJĄCYCH FUNDUSZ			
Data	Imię i Nazwisko	Stanowisko/Funkcja	Podpis
2017-11-03	TOMASZ STADNIK	PREZES ZARZĄDU	.
2017-11-03	JAKUB RYBA	WICEPREZES ZARZĄDU	.