

Komunikat w sprawie zmiany Statutu Rockbridge FIO Strategii Akcyjnej

1.11.2018 r.

Rockbridge Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. na podstawie art. 24 ust. 5, ust. 6 pkt 1 oraz ust. 8a ustawy z dnia 27 maja 2004 r. o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (t.j. Dz. U. 2018, poz. 1355 z późn. zm.) niniejszym ogłasza o następujących zmianach statutu Rockbridge Funduszu Inwestycyjnego Otwartego Strategii Akcyjnej:

- 1) w art. 1:
 - a) ust. 1 otrzymuje brzmienie:

„1. Fundusz prowadzi działalność pod nazwą Rockbridge Fundusz Inwestycyjny Otwarty WIG20 Lewarowany.”,
 - b) ust. 2 otrzymuje brzmienie:

„2. Fundusz może używać skróconej nazwy Rockbridge FIO WIG20 Lewarowany.”;
- 2) w art. 8 ust. 1 otrzymuje brzmienie:

„1. Celem inwestycyjnym Funduszu jest wzrost wartości Aktywów Funduszu w wyniku wzrostu wartości lokat. Realizując cel inwestycyjny Fundusz będzie dążył do odwzorowania stóp zwrotu indeksu WIG20lev.”;
- 3) w art. 10:
 - a) ust. 1 lit a otrzymuje brzmienie:

„a) papiery wartościowe emitowane, poręczone lub gwarantowane przez Skarb Państwa lub Narodowy Bank Polski, papiery wartościowe i Instrumenty Rynku Pieniężnego dopuszczone do obrotu na rynku regulowanym na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej lub w Państwie Członkowskim, a także na rynku zorganizowanym niebędącym rynkiem regulowanym na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej lub w Państwie Członkowskim oraz następujących rynkach zorganizowanych (w państwach należących do OECD innych niż Rzeczpospolita Polska i Państwo Członkowskie): Australia: National Stock Exchange of Australia, Australian Securities Exchange, Islandia: Nasdaq OMX Iceland, Izrael: Tel Aviv Stock Exchange, Japonia: Nagoya Stock Exchange, Osaka Exchange, Tokyo Stock Exchange, Kanada: Montreal Stock Exchange, Toronto Stock Exchange, Vancouver Stock Exchange TSX Venture Exchange, Korea Południowa: Korea Stock Exchange, Meksyk: Mexican Stock Exchange (Bolsa Mexicana de Valores), Norwegia: Oslo Stock Exchange, Nowa Zelandia: New Zealand Stock Exchange, Stany Zjednoczone Ameryki: American Stock Exchange, New York Stock Exchange, Nasdaq Stock Market, Szwajcaria: SIX Swiss Exchange, BX Berne Exchange, Turcja: Istanbul Stock Exchange;”,
 - b) ust. 5 otrzymuje brzmienie:

„5. Fundusz może zawierać umowy mające za przedmiot instrumenty pochodne dopuszczone do obrotu na rynku regulowanym na terytorium Rzeczypospolitej Polskiej lub w Państwie Członkowskim, a także na rynku zorganizowanym niebędącym rynkiem regulowanym w Rzeczypospolitej Polskiej lub Państwie Członkowskim, oraz na rynku zorganizowanym w: Australii (Australian Securities Exchange), Islandii (NASDAQ OMX Iceland), Izraelu (Tel Aviv Stock Exchange),

Japonii (Tokyo Stock Exchange, Osaka Exchange), Kanadzie (Montreal Exchange, Toronto Stock Exchange, ICE Futures Canada), Korei Południowej (Korea Exchange), Meksyku (Mexican Derivatives Exchange), Norwegii (Oslo Stock Exchange), Nowej Zelandii (New Zealand Futures Exchange), Stanach Zjednoczonych Ameryki (NASDAQ, New York Stock Exchange, CME Group, ICE Futures US, New York Mercantile Exchange, New York Board of Trade), Szwajcarii (Eurex Zurich), Turcji (Istanbul Stock Exchange), oraz umowy mające za przedmiot Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne.”,

c) ust. 7 otrzymuje brzmienie:

„7. Fundusz będzie zawierał następujące rodzaje umów mających za przedmiot Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne:

- a) kontrakty terminowe notowane na rynkach, o których mowa w ust. 5,*
- b) kontrakty terminowe typu forward,*
- c) opcje,*
- d) kontrakty wymiany płatności,*
- e) kontrakty na różnicę,*
- f) kontraktowe transakcje terminowe, których bazę stanowią kontrakty terminowe notowane na rynkach wskazanych w ust. 5.;”*

4) w art. 12:

a) ust. 11-14 otrzymują:

„11. Fundusz może inwestować do 100% (stu procent) wartości Aktywów Funduszu w instrumenty dłużne, tj.: obligacje, bony skarbowe, papiery komercyjne, listy zastawne, certyfikaty depozytowe, Instrumenty Rynku Pieniężnego lub w papiery wartościowe nabyte przez Fundusz, co do których istnieje zobowiązanie drugiej strony do ich odkupu.

12. Fundusz może inwestować do 100% (stu procent) wartości Aktywów Funduszu w instrumenty udziałowe, tj.: akcje i obligacje zamienne na akcje, a także w instrumenty finansowe o podobnym poziomie ryzyka emitowane przez spółki lub instytucje wspólnego inwestowania.

13. Fundusz będzie lokował od 50% do 250% wartości Aktywów w kontrakty terminowe na indeks giełdowy WIG20.

14. Maksymalne zaangażowanie Funduszu w lokaty, uwzględniając Instrumenty Pochodne, w tym Niewystandaryzowane Instrumenty Pochodne, wyznacza się poprzez obliczanie całkowitej ekspozycji Funduszu przy zastosowaniu metody względnej wartości zagrożonej.”,

b) po ust. 14 dodaje się ust. 15-17 w brzmieniu:

„15. Określone przez całkowitą ekspozycję maksymalne zaangażowanie, o którym mowa w ust. 14, uwzględniające zawarte przez Fundusz umowy mające za przedmiot Instrumenty Pochodne, nie może w żadnym momencie przekraczać 200% wartości zagrożonej portfela referencyjnego stanowiącego indeks WIG20lev.

16. Część aktywów, która nie będzie ulokowana w instrumentach udziałowych, Fundusz będzie inwestował przede wszystkim w instrumenty dłużne wskazane w ust. 11.

17. Łączna wartość lokat, o których mowa w art. 10 ust. 4, nie może przekraczać 10% (dziesięć procent) wartości Aktywów Funduszu.”;

5) w art. 30:

a) ust. 1:

- lit b – c otrzymują brzmienie:

- „b) opłaty i prowizje bankowe, opłaty i prowizje maklerskie oraz inne opłaty lub prowizje bezpośrednio związane z zawieraniem, rozliczaniem i raportowaniem transakcji,
- c) opłaty wymagane przez instytucje i organizacje w związku z nadaniem i utrzymywaniem oznaczeń Funduszu wymaganych przepisami prawa,”

- lit e otrzymuje brzmienie:

- „e) opłaty skarbowe, sądowe, notarialne, podatki i inne opłaty wymagane przez organy państwowe lub samorządowe, w tym opłaty rejestracyjne i z tytułu udzielenia zgody lub zezwolenia,”

b) ust. 7-8 otrzymują brzmienie:

- „7. Do dnia rozpoczęcia pierwszego okresu rozliczeniowego, o którym mowa w ust. 13, Towarzystwo pobiera wynagrodzenie zmienne, uzależnione od wyników zarządzania Funduszem osiągniętych na koniec każdego okresu obliczeniowego zgodnie z metodologią opisaną w ust. 9. Z zastrzeżeniem ust. 8, okresem obliczeniowym jest rok kalendarzowy.
8. Pierwszym okresem obliczeniowym jest okres przypadający pomiędzy pierwszym Dniem Wyceny Funduszu przypadającym po dniu, w którym weszły w życie postanowienia Statutu dotyczące pobierania wynagrodzenia zmiennego, a ostatnim dniem kalendarzowym w roku, w którym postanowienia te weszły w życie. Ostatni okres obliczeniowy kończy się w Dniu Wyceny bezpośrednio poprzedzającym dzień wejścia w życie zmian Statutu w zakresie ustalania wynagrodzenia zmiennego zgodnie z metodologią opisaną w ust. 15.”

c) ust. 12-15 otrzymują brzmienie:

- „12. Od dnia wejścia w życie zmian Statutu w zakresie ustalania wynagrodzenia zmiennego zgodnie z metodologią opisaną w ust. 15, Towarzystwo jest uprawnione do pobierania wynagrodzenia uzależnionego od wzrostu WANJU.

13. Wynagrodzenie naliczane jest:

- 1) za okres od ostatniego Dnia Wyceny, w którym pobrane zostało wynagrodzenie zmienne lub
- 2) za okres od Dnia Wyceny poprzedzającego dzień wejścia w życie zmian Statutu w zakresie ustalania wynagrodzenia zmiennego zgodnie z metodologią opisaną w ust. 15 jeśli wynagrodzenie zmienne nie było pobrane,

a zakończony

- 1) w ostatnim Dniu Wyceny każdego miesiąca kalendarzowego lub
- 2) w Dniu Wyceny, w którym następuje odkupienie Jednostek Uczestnictwa Funduszu (w wysokości proporcjonalnej do liczby umarzanych Jednostek Uczestnictwa Funduszu) lub

3) w Dniu Wyceny bezpośrednio poprzedzającym dzień rozpoczęcia likwidacji Funduszu - w przypadku likwidacji Funduszu

(„okres rozliczeniowy”).

14. Fundusz, w każdym Dniu Wyceny, tworzy rezerwę na wynagrodzenie uzależnione od wzrostu WANJU zgodnie z zasadami opisanymi poniżej.
15. Wysokość wynagrodzenia zmiennego oraz rezerwy na wynagrodzenie zmienne wyznaczana jest według następującego wzoru:

$WR = WPnJU * LJU$ gdzie:

WR - wartość rezerwy na wynagrodzenie zmienne na dany Dzień Wyceny,

LJU – liczba jednostek uczestnictwa na dany Dzień Wyceny,

jeżeli $[WANJU(1) - WANJU(0)] / WANJU(0) > MSZ$ i jednocześnie $WANJU(1) - WANJU(0) > 0$

to $WPnJU = ST\% * [WANJU(1) - WANJU(0)] - \max([WANJU(0) * MSZ], 0)$

Powyższy warunek oznacza, że dla danego okresu rozliczeniowego wynagrodzenie zmienne zostanie naliczone w przypadku, gdy stopa zwrotu Funduszu będzie dodatnia i jednocześnie wyższa od stopy zwrotu z portfela referencyjnego (parametr MSZ z okresu rozliczeniowego), gdzie:

$WANJU(1)$ – WANJU w danym Dniu Wyceny, przed naliczeniem wynagrodzenia zmiennego,

$WANJU(0)$ – WANJU w ostatnim Dniu Wyceny, w którym pobrane zostało wynagrodzenie zmienne lub WANJU ustalona na Dzień Wyceny poprzedzający dzień wejścia w życie zmian Statutu w zakresie ustalania wynagrodzenia zmiennego zgodnie z metodologią opisaną w ust. 15,

MSZ – wyrażona procentowo zmiana wartości, w bieżącym okresie rozliczeniowym, portfela wzorcowego stanowiącego indeks WIG20lev, przy czym procentowa zmiana wartości portfela wzorcowego jest ustalana w każdym Dniu Wyceny bieżącego okresu rozliczeniowego jako zmiana wartości ogłoszonych w danym Dniu Wyceny w stosunku do wartości portfela wzorcowego w ostatnim Dniu Wyceny poprzedniego okresu rozliczeniowego,

gdzie indeks WIG20lev oznacza publikowany przez GPW indeks, którego wartość jest zależna od wartości indeksu WIG20 (indeksu publikowanego przez GPW odzwierciedlającego wartość portfela akcji 20 największych i najbardziej płynnych spółek z głównego rynku GPW); indeks WIG20lev stanowi dwukrotną dźwignię w stosunku do indeksu WIG20,

WPnJU – wartość rezerwy na Jednostkę Uczestnictwa Funduszu zaokrąglona do dwóch miejsc po przecinku,

ST% – maksymalna stawka procentowa wynagrodzenia zmiennego wynosząca 20%.”,

d) po ust. 15 dodaje się ust. 16 - 19 w brzmieniu:

- „16. Wynagrodzenie zmienne płatne jest przez Fundusz w terminie 7 (siedmiu) dni od dnia jego naliczenia, z zastrzeżeniem, że jeżeli dniem naliczenia wynagrodzenia jest Dzień Wyceny, w którym następuje odkupienie Jednostek Uczestnictwa Funduszu, wypłacie podlega ta część utworzonej rezerwy, która przypada proporcjonalnie na umorzone Jednostki Uczestnictwa Funduszu (i w takiej

sytuacji wypłata środków następuje po zakończeniu miesiąca, w którym nastąpiło odkupienie Jednostek Uczestnictwa Funduszu) lub cała utworzona rezerwa, jeżeli dniem umorzenia Jednostek Uczestnictwa Funduszu jest ostatni Dzień Wyceny w miesiącu kalendarzowym (a w przypadku likwidacji Funduszu Dzień Wyceny bezpośrednio poprzedzający dzień rozpoczęcia likwidacji Funduszu).

17. *Towarzystwo może pobierać wynagrodzenie za zarządzanie Funduszem według stawek niższych niż maksymalne stawki, określone w ust. 5, ust. 9 lub ust. 15.*
18. *Z zastrzeżeniem ust. 6, ust. 11 oraz ust. 16, koszty Funduszu pokrywane są w terminach określonych w umowach, przepisach prawa lub decyzjach właściwych organów.*
19. *Towarzystwo może postanowić o pokrywaniu z aktywów Towarzystwa wybranych przez Towarzystwo kategorii kosztów, o których mowa w ust. 1 przez czas nieoznaczony lub oznaczony.”.*

Na dokonanie zmian art. 10 ust. 1 lit a, art. 10 ust. 5 oraz art. 30 statutu Funduszu Komisja Nadzoru Finansowego udzieliła zezwolenia decyzją nr DFF-FIO.4022.1.18.2018.AS z dnia 19 października 2018 r.

W pozostałym zakresie nie było wymagane uzyskanie zezwolenia Komisji, niemniej pozostałe zmiany mają bezpośredni związek ze zmianami statutu wymagającymi uzyskanie zezwolenia.

Zmiany wchodzi w życie w terminie 3 miesięcy od dnia ich ogłoszenia, tj. w dniu 1 lutego 2019r.