INFORMACJA DLA KLIENTA ALTERNATYWNEGO FUNDUSZU INWESTYCYJNEGO

ROCKBRIDGE NEO SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY

OKRESOWE UJAWNIENIA

sporządzona na dzień 31 grudnia 2025 r. za okres sprawozdawczy od 1 stycznia 2025 r.– 31 grudnia 2025 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 2026 r., poz. 60 z późn. zm.; „Ustawa"), stosownie do treści Informacji dla Klienta Alternatywnego Funduszu Inwestycyjnego („IDK")

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

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 odkupienia jednostek uczestnictwa na wypadek niepłynności aktywów Funduszu.

[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).*

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

System zarządzania ryzykiem obejmuje wszystkie komórki organizacyjne Towarzystwa. Departament Zarządzania Ryzykiem odpowiedzialny za nadzór nad systemem zarządzania ryzykiem podlega bezpośrednio Zarządowi a także przedstawia regularne sprawozdania Radzie Nadzorczej Towarzystwa sprawującej nadzór na systemami kontroli wewnętrznej i zarządzania ryzykiem. System zarządzania ryzykiem działa w oparciu o komitety produktowe a także Komitet Nadzoru, sprawujący nadrzędną rolę w procesie ograniczania ryzyka w Towarzystwie. System zarządzania ryzykiem podlega ocenie biegłego rewidenta przynajmniej raz do roku.

W ramach systemu zarządzania ryzykiem Towarzystwo identyfikuje ryzyka w zarządzanych funduszach i dla wszystkich istotnych czynników ryzyka ustanawia limity wewnętrzne będące uzupełnieniem zapisów statutowych w ramach ograniczania zaangażowania w poszczególne czynniki ryzyka. W szczególności Towarzystwo identyfikuje profil płynności funduszy i ustanawia maksymalne zaangażowania w instrumenty o ograniczonej płynności. System limitów wewnętrznych wspierany przez system alertów ostrzegawczych o charakterze informacyjnym.

Profil ryzyka definiowany jako SRI (Summary Risk Indicator), czyli wskaźnik ryzyka wyliczany w oparciu o metodologię przewidzianą w rozporządzeniu delegowanym Komisji (UE) 2017/653 z dnia 8 marca 2017 r. uzupełniającym rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 1286/2014 w sprawie dokumentów zawierających kluczowe informacje, dotyczących detalicznych produktów zbiorowego inwestowania i ubezpieczeniowych produktów inwestycyjnych (PRIIP) przez ustanowienie regulacyjnych standardów technicznych w zakresie prezentacji, treści, przeglądu i zmiany dokumentów zawierających kluczowe informacje oraz warunków spełnienia wymogu przekazania takich dokumentów (Rozporządzenie PRIIP). Wskaźnik SRI przyjmuje wartość liczby całkowitej z zakresu <1,7>.

Na datę bilansową profil ryzyka poszczególnych subfunduszy wydzielonych w ramach Rockbridge Neo SFIO wyniósł:

Nazwa Subfunduszu	SRI
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Rynku Polskiego	2
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Obligacji Plus	2
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Obligacji Światowych	2
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Azji i Rynków Wschodzących	3
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Rynków Wschodzących	4
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Rynków Rozwiniętych	4
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Chińskich i Azjatyckich	4
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Amerykańskich	4
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Konserwatywny Plus	2

Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Polskich	4
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Nowa Europa	4
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Małych Spółek	4
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Ameryki Łacińskiej	4
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Europejskich	3

Łącznej wysokości zastosowanej dźwigni finansowej AFI na dzień bilansowy

Łączna ekspozycja wyznaczona metodą zaangażowania wyniosła na dzień 31 grudnia 2025 r.:

Nazwa Subfunduszu	AFI - ekspozycja obliczona metodą zaangażowania
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Rynku Polskiego	100,00%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Obligacji Plus	118,45%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Obligacji Światowych	100,84%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Azji i Rynków Wschodzących	100,22%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Rynków Wschodzących	100,24%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Rynków Rozwiniętych	100,25%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Chińskich i Azjatyckich	100,53%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Amerykańskich	100,40%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Konserwatywny Plus	162,75%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Polskich	101,61%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Nowa Europa	100,45%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Małych Spółek	100,00%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Ameryki Łacińskiej	102,34%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Europejskich	100,02%

Łączna ekspozycja wyznaczona metodą brutto wyniosła na dzień 31 grudnia 2025 r.:

Nazwa Subfunduszu	AFI - ekspozycja obliczona metodą brutto
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Rynku Polskiego	86,87%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Obligacji Plus	116,98%

Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Obligacji Światowych	182,75%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Azji i Rynków Wschodzących	177,53%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Rynków Wschodzących	190,95%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Rynków Rozwiniętych	195,98%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Chińskich i Azjatyckich	197,18%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Amerykańskich	194,57%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Konserwatywny Plus	162,57%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Polskich	87,17%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Nowa Europa	108,72%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Małych Spółek	86,45%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Ameryki Łacińskiej	211,82%
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Europejskich	189,72%

INFORMACJE UJAWNIANE W ZWIĄZKU Z ART. 109 ROZPORZĄDZENIA UE NR 231/2013:

Ekspozycja alternatywnego funduszu inwestycyjnego (Funduszu) liczona jest zgodnie z Rozporządzeniem Delegowanym Komisji nr 231/2013 uzupełniającego dyrektywę Parlamentu Europejskiego i Rady 2011/61/UE w odniesieniu do zwolnień, ogólnych warunków dotyczących prowadzenia działalności, depozytariuszy, dźwigni finansowej, przejrzystości i nadzoru (Rozporządzenie) - poprzez obliczenie dźwigni finansowej zarówno metodą brutto jak i metodą zaangażowania opisanymi w niniejszym Rozporządzeniu, odpowiednio w Art. 7 i Art. 8 oraz jego Załącznikach I i II.

Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Rynku Polskiego

Metoda pomiaru dźwigni AFI [%]	Górny próg limitu ustawowego	Wartość w okresie sprawozdawczym			
		Najniższa	Najwyższa	Przeciętna	Na dzień bilansowy
Metoda brutto	Nie dotyczy	82,33%	98,73%	94,77%	86,87%
Metoda zaangażowania	200%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%

Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Obligacji Plus

Metoda pomiaru dźwigni AFI [%]	Górny próg limitu ustawowego	Wartość w okresie sprawozdawczym			
		Najniższa	Najwyższa	Przeciętna	Na dzień bilansowy
Metoda brutto	Nie dotyczy	101,54%	184,31%	142,40%	116,98%
Metoda zaangażowania	200%	101,94%	185,40%	143,01%	118,45%

Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Obligacji Światowych

Metoda pomiaru dźwigni AFI [%]	Górny próg limitu ustawowego	Wartość w okresie sprawozdawczym			
		Najniższa	Najwyższa	Przeciętna	Na dzień bilansowy
Metoda brutto	Nie dotyczy	174,94%	306,62%	194,20%	182,75%
Metoda zaangażowania	200%	96,81%	106,36%	100,30%	100,84%

Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Azji i Rynków Wschodzących

Metoda pomiaru dźwigni AFI [%]	Górny próg limitu ustawowego	Wartość w okresie sprawozdawczym			
		Najniższa	Najwyższa	Przeciętna	Na dzień bilansowy
Metoda brutto	Nie dotyczy	170,05%	321,52%	198,63%	177,53%
Metoda zaangażowania	200%	96,18%	108,20%	99,79%	100,22%

Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Rynków Wschodzących

Metoda pomiaru dźwigni AFI [%]	Górny próg limitu ustawowego	Wartość w okresie sprawozdawczym			
		Najniższa	Najwyższa	Przeciętna	Na dzień bilansowy
Metoda brutto	Nie dotyczy	180,14%	295,29%	196,97%	190,95%
Metoda zaangażowania	200%	96,27%	107,33%	100,06%	100,24%

Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Rynków Rozwiniętych

Metoda pomiaru dźwigni AFI [%]	Górny próg limitu ustawowego	Wartość w okresie sprawozdawczym			
		Najniższa	Najwyższa	Przeciętna	Na dzień bilansowy
Metoda brutto	Nie dotyczy	178,46%	323,05%	199,93%	195,98%
Metoda zaangażowania	200%	96,22%	115,14%	100,20%	100,25%

Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Chińskich i Azjatyckich

Metoda pomiaru dźwigni AFI [%]	Górny próg limitu ustawowego	Wartość w okresie sprawozdawczym			
		Najniższa	Najwyższa	Przeciętna	Na dzień bilansowy
Metoda brutto	Nie dotyczy	176,57%	300,68%	196,52%	197,18%
Metoda zaangażowania	200%	96,28%	111,94%	100,06%	100,53%

Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Amerykańskich

Metoda pomiaru dźwigni AFI [%]	Górny próg limitu ustawowego	Wartość w okresie sprawozdawczym			
		Najniższa	Najwyższa	Przeciętna	Na dzień bilansowy
Metoda brutto	Nie dotyczy	169,46%	343,39%	196,50%	194,57%
Metoda zaangażowania	200%	96,42%	115,54%	100,38%	100,40%

Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Konserwatywny Plus

Metoda pomiaru dźwigni AFI [%]	Górny próg limitu ustawowego	Wartość w okresie sprawozdawczym			
		Najniższa	Najwyższa	Przeciętna	Na dzień bilansowy
Metoda brutto	Nie dotyczy	100,27%	166,40%	146,62%	162,57%
Metoda zaangażowania	200%	100,62%	166,85%	147,31%	162,75%

Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Polskich

Metoda pomiaru dźwigni AFI [%]	Górny próg limitu ustawowego	Wartość w okresie sprawozdawczym			
		Najniższa	Najwyższa	Przeciętna	Na dzień bilansowy
Metoda brutto	Nie dotyczy	82,60%	112,31%	92,15%	87,17%
Metoda zaangażowania	200%	100,00%	119,35%	104,79%	101,61%

Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Nowa Europa

Metoda pomiaru dźwigni AFI [%]	Górny próg limitu ustawowego	Wartość w okresie sprawozdawczym			
		Najniższa	Najwyższa	Przeciętna	Na dzień bilansowy
Metoda brutto	Nie dotyczy	102,03%	131,47%	109,44%	108,72%
Metoda zaangażowania	200%	100,19%	101,24%	100,48%	100,45%

Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Małych Spółek

Metoda pomiaru dźwigni AFI [%]	Górny próg limitu ustawowego	Wartość w okresie sprawozdawczym			
		Najniższa	Najwyższa	Przeciętna	Na dzień bilansowy
Metoda brutto	Nie dotyczy	79,55%	116,22%	92,93%	86,45%
Metoda zaangażowania	200%	100,00%	119,70%	108,09%	100,00%

Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Ameryki Łacińskiej

Metoda pomiaru dźwigni AFI [%]	Górny próg limitu ustawowego	Wartość w okresie sprawozdawczym			
		Najniższa	Najwyższa	Przeciętna	Na dzień bilansowy
Metoda brutto	Nie dotyczy	160,84%	289,37%	196,15%	211,82%
Metoda zaangażowania	200%	97,89%	109,86%	100,97%	102,34%

Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Europejskich

Metoda pomiaru dźwigni AFI [%]	Górny próg limitu ustawowego	Wartość w okresie sprawozdawczym			
		Najniższa	Najwyższa	Przeciętna	Na dzień bilansowy
Metoda brutto	Nie dotyczy	180,65%	300,65%	195,54%	189,72%
Metoda zaangażowania	200%	98,06%	113,40%	100,21%	100,02%