

**Zmiana Statutu Rockbridge Funduszu Inwestycyjnego Zamkniętego Dochodowych Surowców
z dnia 8 grudnia 2017 r.**

Rockbridge Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. na podstawie art. 24 ust. 5 oraz art. 24 ust. 8 pkt 2) Ustawy z dnia 27 maja 2004 r. o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (t.j. Dz. U. 2016, poz. 1896 z późn. zm.) niniejszym ogłasza zmiany statutu Rockbridge Funduszu Inwestycyjnego Zamkniętego Dochodowych Surowców (dalej: Fundusz) w ten sposób, że:

- 1) w art. 2 dodaje się definicję „*CCP*” w następującym brzmieniu:
„**CCP** – podmiot, o którym mowa w art. 2 pkt 1 rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 z dnia 4 lipca 2012 r. w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji (Dz. Urz. UE L 201 z 27.07.2012, str. 1, z późn. zm.), prowadzący działalność na podstawie zezwolenia, o którym mowa w art. 14 tego rozporządzenia, albo uznany przez Europejski Organ Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych na podstawie art. 25 tego rozporządzenia.”;
- 2) w art. 2 dodaje się definicję „*Ekspozycja AFI*” w następującym brzmieniu:
„**Ekspozycja AFI** – oznacza to ekspozycję w rozumieniu art. 2 pkt 42a Ustawy,”
- 3) w art. 2 dodaje się definicję „*Rozporządzenie 231/2013*” w następującym brzmieniu:
„**Rozporządzenie 231/2013** – oznacza 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 83 z 22.03.2013, str. 1)”
- 4) w art. 3 ust. 3 otrzymuje następujące nowe brzmienie:
„3. Towarzystwo jako organ Funduszu zarządza Funduszem oraz reprezentuje Fundusz w stosunkach z osobami trzecimi. Do składania oświadczeń woli w imieniu Towarzystwa uprawnieni są dwaj członkowie zarządu łącznie albo jeden członek zarządu łącznie z prokurentem, w tym także z jednym prokurentem łącznym.”;
- 5) w art. 19 ust. 2 otrzymuje następujące nowe brzmienie:
„2. Z lokatami w Towarowe Instrumenty Pochodne związane są następujące rodzaje ryzyka:
 - 1) ryzyko rynkowe, tj. ryzyko poniesienia przez Fundusz straty wynikającej z wahań wartości rynkowych pozycji wchodzących w skład Aktywów Funduszu na skutek fluktuacji

zmiennych rynkowych, takich jak: metale, surowce energetyczne lub inne rzeczy oznaczone co do gatunku, energia, mierniki i limity wielkości produkcji lub emisji zanieczyszczeń. Ryzyko to jest zarządzane na poziomie ekspozycji na globalne ryzyko cen towarów a także uwzględniane w ramach obliczeń w zakresie Ekspozycji AFI zgodnie z Rozporządzeniem 231/2013;

- 2) ryzyko dźwigni finansowej, tj. ryzyko, że w przypadku nietrafnych decyzji inwestycyjnych inwestowanie w Towarowe Instrumenty Pochodne może prowadzić do zwielokrotnienia strat w porównaniu do pozostałych lokat Funduszu. W celu pomiaru ryzyka dźwigni finansowej Fundusz oblicza sumę wartości wszystkich kwot zaangażowania w Instrumenty Pochodne w sposób określony przepisami Rozporządzenia 231/2013 oraz uwzględnia ją przy stosowaniu limitów inwestycyjnych;
 - 3) ryzyko płynności, tj. ryzyko braku możliwości – w odpowiednio krótkim okresie czasu – sprzedaży, likwidacji lub zamknięcia pozycji na Towarowych Instrumentach Pochodnych bez znaczącego negatywnego wpływu na Wartość Aktywów Netto Funduszu; przy czym ryzyko to zarządzane jest w Funduszu na poziomie globalnym uwzględniając pozycje w instrumentach i ich obroty na rynku a także oczekiwane wykupy Certyfikatów Inwestycyjnych Funduszu;
 - 4) ryzyko operacyjne tj. ryzyko poniesienia przez Fundusz straty wynikającej z nieodpowiednich procesów wewnętrznych i nieprawidłowości dotyczących systemów towarzystwa, zasobów ludzkich lub wynikającej ze zdarzeń zewnętrznych, obejmujące ryzyko prawne i dokumentacyjne oraz ryzyko wynikające ze stosowanych w imieniu Funduszu procedur zawierania transakcji, rozliczania i wyceny. Zarządzanie ryzykiem operacyjnym odbywa się na poziomie Towarzystwa przy zastosowaniu metod jakościowych i ilościowych;
 - 5) ryzyko rozliczenia transakcji – tj. ryzyko związane z możliwością występowania błędów lub opóźnień w rozliczeniach transakcji, których przedmiotem są Towarowe Instrumenty Pochodne, przy czym ryzyko to jest zarządzane w Towarzystwie w ramach procesu zarządzania ryzykiem operacyjnym;
 - 6) ryzyko modelu - ryzyko wystąpienia różnicy pomiędzy wyceną rynkową a wyceną teoretyczną opartą na prawidłowo skonstruowanym modelu, przy czym ryzyko to jest zarządzane w Towarzystwie w ramach procesu zarządzania ryzykiem operacyjnym.”.
- 6)** w art. 40 dodaje się ust. 7 w następującym brzmieniu:
- „7. Sprawozdania finansowe Funduszu będą badane lub będą podlegały przeglądowi zgodnie z obowiązującymi przepisami prawa przez biegłego rewidenta, wybranego przez

Radę Nadzorczą Towarzystwa i będą publikowane na stronie internetowej <http://www.rockbridge.pl>”

7) w art. 41 skreśla się ust. 8.

Pozostałe postanowienia statutu Rockbridge Funduszu pozostają bez zmian.

Powyżej wskazane zmiany w Statucie Funduszu wchodzi w życie z dniem ukazania się niniejszego ogłoszenia tj. 8 grudnia 2017 r., za wyjątkiem zmian wskazanych w pkt 5, które to zmiany wchodzi w życie w terminie 3 miesięcy od dnia ukazania się niniejszego ogłoszenia tj. 9 marca 2018 r.