INFORMACJA DLA KLIENTA ALTERNATYWNEGO FUNDUSZU INWESTYCYJNEGO

ROCKBRIDGE FUNDUSZ INWESTYCYJNY ZAMKNIĘTY SMALL CAPS + w likwidacji

sporządzona na dzień 31 grudnia 2025 r. za okres sprawozdawczy od 1 stycznia 2025 r. do 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 poźn. 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 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).*

Informacja o zmianach maksymalnego poziomu dźwigni finansowej, który może być stosowany w imieniu funduszu oraz prawie do ponownego wykorzystania zabezpieczeń lub gwarancji udzielonej na podstawie porozumienia dotyczącego dźwigni finansowej AFI

Maksymalny poziom dźwigni finansowej AFI wyliczony przy zastosowaniu metody zaangażowania wynosi 400% zgodnie z § 3 pkt 2) *Rozporządzenia Ministra Rozwoju i Finansów z dnia 20 lipca 2017 r. w sprawie maksymalnego limitu ekspozycji AFI (Dz. U. poz. 1443)*. Maksymalny poziom dźwigni finansowej wyliczony przy zastosowaniu metody zaangażowania ustanowiony w procedurach wewnętrznych Towarzystwa na koniec okresu sprawozdawczego wynosi 360%. W okresie sprawozdawczym nie było zmian tego poziomu. Z zastrzeżeniem przepisów prawa ograniczających wysokość dźwigni finansowej Funduszu, nie istnieją prawne ograniczenia dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń. Fundusz nie jest stroną umów, które zawierałyby postanowienia ograniczające ponowne wykorzystanie zabezpieczeń.

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

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.

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Krzysztof Mazurek
Data: 2026.03.10 10:50:36 CET

W ramach systemu zarzadzania 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. System limitów wewnętrznych wspierany jest 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 wyniósł 4.

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Paweł Andrzej Cichoń
Data: 2026.03.10 11:12:21 CET

Łączna wysokość zastosowanej dźwigni finansowej AFI na dzień bilansowy

Wysokość dźwigni finansowej AFI na dzień 31 grudnia 2025 r.:

metoda zaangażowania: 100%

metoda brutto: 0%

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Jakub Ryba
Data: 2026.03.10 16:29:31 CET

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Arkadiusz Famirski
Data: 2026.03.10 11:21:20 CET

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Michał Tuczyński
Data: 2026.03.10 11:30:58 CET

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Piotr Tadeusz Franaszczuk
Data: 2026.03.10 11:40:33 CET