INFORMACJA DLA KLIENTA ALTERNATYWNEGO FUNDUSZU INWESTYCYJNEGO

ROCKBRIDGE FUNDUSZ INWESTYCYJNY ZAMKNIĘTY SMALL CAPS +

OKRESOWE UJAWNIENIA

sporządzona na dzień 30 czerwca 2021 r. za okres sprawozdawczy od 1 stycznia – 30 czerwca 2021 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 2021 r., poz. 605 z pożn. 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 umorzenia certyfikatów 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 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. 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 funduszu definiowany jako miara ustalana na podstawie zanalizowanej zmienności miesięcznych stóp zwrotu za okres ostatnich 3 lat obliczonych na podstawie szacunkowych wycen certyfikatu inwestycyjnego. W przypadku braku dokonania oficjalnej wyceny certyfikatu inwestycyjnego na dany dzień wyceny, do kalkulacji przyjmowana jest szacunkowa wycena ustalana przez księgowość funduszu. W przypadku braku historycznych wycen dla Funduszu za okres ostatnich 3 lat działania zgodnie z bieżącą polityką inwestycyjną, do danych historycznych zastępczo może być wykorzystany benchmark Funduszu, portfel modelowy lub stopy zwrotu innego fundusz o zbliżonej polityce inwestycyjnej. Na datę bilansową profil ryzyka wyniósł 7.

Skala zmienności stóp zwrotu:
1 – zmienność stóp zwrotu z certyfikatu w przedziale 0%-0,5%
2 – zmienność stóp zwrotu z certyfikatu w przedziale 0,5%-2%
3 – zmienność stóp zwrotu z certyfikatu w przedziale 2%-5%
4 – zmienność stóp zwrotu z certyfikatu w przedziale 5%-10%
5 – zmienność stóp zwrotu z certyfikatu w przedziale 10%-15%
6 – zmienność stóp zwrotu z certyfikatu w przedziale 15%-20%
7 – zmienność stóp zwrotu z certyfikatu powyżej 20%

Łącznej wysokości zastosowanej dźwigni finansowej AFI na dzień bilansowy

Wysokość dźwigni finansowej zastosowanej przez Fundusz obliczanej jako iloraz ekspozycji AFI i Wartości Aktywów Netto Funduszu wynosił na dzień 30 czerwca 2021 r.:
metoda zaangażowania: 103,45%
metoda brutto: 86,53%