INFORMACJA DLA KLIENTA ALTERNATYWNEGO FUNDUSZU INWESTYCYJNEGO

ROCKBRIDGE FUNDUSZ INWESTYCYJNY ZAMKNIĘTY POLISH OPPORTUNITIES

OKRESOWE UJAWNIENIA

sporządzona na dzień 31 grudnia 2018 r. za okres sprawozdawczy od 13 listopada 2017 r. do 31 grudnia 2018 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 2016 r., poz. 1896 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 w trybie aktualizacji IDK 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).*

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

Aktualny profil ryzyka określono na 3 w siedmiostopniowej skali i stanowi on ogólny wskaźnik ryzyka i zysku zawarty w Dokumencie Zawierającym Kluczowe Informacje o Funduszu (KIID), co stanowi średnio niską klasę ryzyka.

Towarzystwo identyfikuje i stosuje limity inwestycyjne dla w szczególności następujących ryzyk:

1) ryzyko rynkowe (limity dla każdego czynnika ryzyka);
2) ryzyko kredytowe i kontrahenta;
3) ryzyko płynności

odpowiednio do stosowanej przez Fundusz polityki inwestycyjnej i zgodnie z metodykami określonymi w wewnętrznych procedurach.

Ryzyko operacyjne zarządzane jest globalnie na poziomie procesowym.

Globalny poziom ryzyka określany jest przez ekspozycję AFI zgodnie z zapisami Rozporządzenia 231/2013. Limit ekspozycji AFI wyznaczonej metodą zaangażowania wynosi 400% WAN Funduszu.

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 31 grudnia 2018 r.:

metoda zaangażowania: 121,67%

metoda brutto: 95,72%