

skorygowany

KOMISJA NADZORU FINANSOWEGO

Raport kwartalny FIZ-Q-E

za 3 kwartał 2017 roku obejmujący okres od 2017-07-01 do 2017-09-30

podstawa prawna:

§ 82 ust. 1 pkt 1 Rozporządzenia Ministra Finansów z dnia 19 lutego 2009 r. w sprawie informacji bieżących i okresowych przekazywanych przez emitentów papierów wartościowych oraz warunków uznawania za równoważne informacji wymaganych przepisami prawa państwa niebędącego państwem członkowskim (Dz. U. nr 33, poz. 259 z późn. zm.)

Data przekazania: 2017-11-03

| | | |
|--|--|---------------------------|
| ROCKBRIDGE FUNDUSZ INWESTYCYJNY ZAMKNIĘTY BEZPIECZNA INWESTYCJA 5 | | |
| (pełna nazwa funduszu) | | |
| ROCKBRIDGE FIZ BEZPIECZNA INWESTYCJA 5 | ROCKBRIDGE TOWARZYSTWO FUNDUSZY INWESTYCYJNYCH S.A. | |
| (skrótowa nazwa funduszu) | (nazwa towarzystwa) | |
| 00-203 | WARSZAWA | |
| (kod pocztowy) | (mięscowość) | |
| BONIFRATERSKA | | 17 |
| (ulica) | | (numer) |
| (0-22) 538 97 77 | (0-22) 538 97 98 | info@rockbridge.pl |
| (telefon) | (fax) | (e-mail) |
| 107-00-04-713 | 140586201 | www.rockbridge.pl |
| (NIP) | (REGON) | (WWW) |

KOMISJA NADZORU FINANSOWEGO

Informacje o funduszu

| | | | |
|------------------------------|--------------------------|----------------------------------|--------------------------|
| Konstrukcja funduszu: | | Typ funduszu: | |
| Subfundusz: | <input type="checkbox"/> | Fundusz sekurytyzacyjny: | <input type="checkbox"/> |
| Fundusz podstawowy: | <input type="checkbox"/> | Fundusz portfelowy: | <input type="checkbox"/> |
| Fundusz powiązany: | <input type="checkbox"/> | Fundusz aktywów niepublicznych: | <input type="checkbox"/> |
| | | Waluta sprawozdania finansowego: | zł |

| | |
|---------------------------------------|-------------------------------|
| | (nazwa funduszu podstawowego) |
| Fundusze powiązane: | |
| | (nazwy funduszy powiązanych) |
| Fundusz z wydzielonymi subfunduszami: | |
| | (nazwa funduszu) |

| Plik | Opis |
|------------------------------|------|
| BI5 09_2017 WPROWADZENIE.rtf | |

| WYBRANE DANE FINANSOWE | w tys. zł. | w tys. EUR |
|---|------------|------------|
| I. Przychody z lokat | 114 | 27 |
| II. Koszty funduszu netto | 97 | 23 |
| III. Przychody z lokat netto | 17 | 4 |
| IV. Zrealizowane zyski (straty) ze zbycia lokat | -43 | -10 |
| V. Niezrealizowane zyski (straty) z wyceny lokat | 32 | 7 |
| VI. Wynik z operacji | 6 | 1 |
| VII. Zobowiązania | 30 | 7 |
| VIII. Aktywa | 18 777 | 4 358 |
| IX. Aktywa netto | 18 747 | 4 351 |
| X. Liczba zarejestrowanych certyfikatów inwestycyjnych | 155 106 | 155 106 |
| XI. Wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny | 120,87 | 28,05 |
| XII. Wynik z operacji na certyfikat inwestycyjny | 0,04 | 0,01 |
| pozycja X. wykazana w szt. | | |
| pozycje XI i XII odpowiednio: w zł. i EUR | | |
| pozycje bilansu w tys. EUR są przeliczone wg. średniego kursu NBP z dnia 29 września 2017 r. | | |
| pozycje rachunku wyników w tys. EUR są przeliczone wg. średniej arytmetycznej kursów NBP z dnia 31 lipca, 31 sierpnia i 29 września 2017 r. | | |

ZESTAWIENIE LOKAT

| SKŁADNIKI LOKAT | 3 kwartał | | | 2 kwartał | | | 2016 |
|---|------------------------------------|---|-------------------------------------|------------------------------------|---|-------------------------------------|--------|
| | 2017 roku | | | 2017 roku | | | |
| | Wartość według ceny nabycia w tys. | Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys. | Procentowy udział w aktywach ogółem | Wartość według ceny nabycia w tys. | Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys. | Procentowy udział w aktywach ogółem | |
| 1. Akcje | 410 | 497 | 2,65 | 407 | 468 | 2,44 | 411 |
| 2. Warranty subskrypcyjne | 0 | 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 | 0 |
| 3. Prawa do akcji | 0 | 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 | 0 |
| 4. Prawa poboru | 0 | 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 | 0 |
| 5. Kwity depozytowe | 0 | 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 | 0 |
| 6. Listy zastawne | 0 | 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 | 0 |
| 7. Dłużne papiery wartościowe | 16 424 | 16 513 | 87,94 | 16 930 | 17 339 | 90,45 | 18 867 |
| 8. Instrumenty pochodne | 0 | 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 | 0 |
| 9. Udziały w spółkach z ograniczoną odpowiedzialnością | 0 | 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 | 0 |
| 10. Jednostki uczestnictwa | 0 | 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 | 0 |
| 11. Certyfikaty inwestycyjne | 0 | 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 | 0 |
| 12. Tytuły uczestnictwa emitowane przez instytucje w wspólnego inwestowania mające siedzibę za granicą | 0 | 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 | 0 |
| 13. Wierzytelności | 0 | 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 | 0 |
| 14. Weksle | 0 | 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 | 0 |
| 15. Depozyty | 0 | 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 | 0 |
| 16. Waluty | 0 | 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 | 0 |
| 17. Nieruchomości | 0 | 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 | 0 |
| 18. Statki morskie | 0 | 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 | 0 |
| 19. Inne | 0 | 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 | 0 |
| Fundusz zaprzestał prezentowania niezrealizowanego zysku z wyceny kontraktów terminowych w tabeli głównej i tabeli uzupełniającej. Niezrealizowany zysk lub strata z wyceny kontraktów terminowych jest prezentowany w bilansie w pozycji "środki pieniężne". Rozliczenia z tytułu kontraktów terminowych są dokonywane codziennie. | | | | | | | |
| Dłużne papiery wartościowe prezentowane są łącznie z odsetkami. | | | | | | | |
| Fundusz nie prezentuje depozytów overnight jako składnika lokat. | | | | | | | |

TABELE ZUPEŁNIAJĄCE

| rok | | 3 kwartał | | |
|--------|-------|---|-------------------------------------|------------------------------------|
| | | 2016 roku | | |
| | | Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys. | Procentowy udział w aktywach ogółem | Wartość według ceny nabycia w tys. |
| 400 | 1,95 | 411 | 350 | 1,65 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 19 059 | 93,11 | 19 170 | 19 272 | 90,67 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0,00 | 0 | 0 | 0,00 |

| AKCJE | Rodzaj rynku | Nazwa rynku | Liczba | Kraj siedziby emitenta | Wartość według ceny nabycia w tys. | Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys. |
|--|----------------------------------|---|--------|------------------------|------------------------------------|---|
| 1. Alior Bank S.A. (PLALIOR00045) | Aktywny rynek - rynek regulowany | Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie | 202 | RZECZPOSPOLITA POLSKA | 12 | 14 |
| 2. ASSECO POLAND S.A. (PLSOFTB00016) | Aktywny rynek - rynek regulowany | Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie | 164 | RZECZPOSPOLITA POLSKA | 7 | 8 |
| 3. Bank Polska Kasa Opieki S.A. (PLPEKAO00016) | Aktywny rynek - rynek regulowany | Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie | 346 | RZECZPOSPOLITA POLSKA | 52 | 44 |
| 4. Bank Zachodni WBK S.A. (PLBZ00000044) | Aktywny rynek - rynek regulowany | Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie | 66 | RZECZPOSPOLITA POLSKA | 19 | 23 |
| 5. CCC S.A. (PLCCC0000016) | Aktywny rynek - rynek regulowany | Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie | 58 | RZECZPOSPOLITA POLSKA | 9 | 16 |
| 6. CYFROWY POLSAT S.A. (PLCFRPT00013) | Aktywny rynek - rynek regulowany | Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie | 472 | RZECZPOSPOLITA POLSKA | 12 | 12 |
| 7. ENERGA S.A. (PLENERG00022) | Aktywny rynek - rynek regulowany | Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie | 442 | RZECZPOSPOLITA POLSKA | 12 | 6 |
| 8. EUROCASH S.A. (PLEURCH00011) | Aktywny rynek - rynek regulowany | Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie | 172 | RZECZPOSPOLITA POLSKA | 9 | 7 |
| 9. Grupa Lotos S.A. (PLLOTOS00025) | Aktywny rynek - rynek regulowany | Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie | 190 | RZECZPOSPOLITA POLSKA | 7 | 11 |
| 10. JASTRZĘBSKA SPÓŁKA WĘGLOWA S.A. (PLJSW0000015) | Aktywny rynek - rynek regulowany | Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie | 116 | RZECZPOSPOLITA POLSKA | 12 | 11 |
| 11. KGHM Polska Miedź S.A. (PLKGHM000017) | Aktywny rynek - rynek regulowany | Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie | 300 | RZECZPOSPOLITA POLSKA | 28 | 35 |
| 12. LPP S.A. (PLLPP0000011) | Aktywny rynek - rynek regulowany | Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie | 4 | RZECZPOSPOLITA POLSKA | 29 | 33 |
| 13. mBank S.A. (PLBRE0000012) | Aktywny rynek - rynek regulowany | Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie | 28 | RZECZPOSPOLITA POLSKA | 4 | 12 |
| 14. Orange Polska S.A. (PLTLKPL00017) | Aktywny rynek - rynek regulowany | Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie | 1 426 | RZECZPOSPOLITA POLSKA | 16 | 8 |
| 15. PGE Polska Grupa Energetyczna S.A. (PLPGER000010) | Aktywny rynek - rynek regulowany | Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie | 1 754 | RZECZPOSPOLITA POLSKA | 33 | 23 |
| 16. Polski Koncern Naftowy ORLEN S.A. (PLPKN0000018) | Aktywny rynek - rynek regulowany | Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie | 634 | RZECZPOSPOLITA POLSKA | 24 | 77 |
| 17. Polskie Górnictwo Naftowe i Gazownictwo S.A. (PLPGNIG00014) | Aktywny rynek - rynek regulowany | Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie | 3 578 | RZECZPOSPOLITA POLSKA | 12 | 24 |
| 18. Powszechna Kasa Oszczędności Bank Polski S.A. (PLPKO0000016) | Aktywny rynek - rynek regulowany | Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie | 1 888 | RZECZPOSPOLITA POLSKA | 61 | 67 |
| 19. Powszechny Zakład Ubezpieczeń S.A. (PLPZU0000011) | Aktywny rynek - rynek regulowany | Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie | 1 252 | RZECZPOSPOLITA POLSKA | 42 | 58 |
| 20. TAURON Polska Energia S.A. (PLTAURN00011) | Aktywny rynek - rynek regulowany | Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie | 2 298 | RZECZPOSPOLITA POLSKA | 11 | 9 |

| DŁUŻNE PAPIERY WARTOŚCIOWE | Rodzaj rynku | Nazwa rynku | Emitent | Kraj siedziby emitenta | Termin wykupu | Warunki oprocentowania |
|--|----------------------------------|---------------------------|----------------------|------------------------|---------------|------------------------|
| 1. O terminie wykupu do 1 roku: | | | | | | |
| a) Obligacje | | | | | | |
| - PS0718 (PL0000107595) | Aktywny rynek - rynek regulowany | Treasury Bond Spot Poland | SKARB PAŃSTWA POLSKI | RZECZPOSPOLITA POLSKA | 2018-07-25 | stałe 2,50 |

| INSTRUMENTY POCHODNE | Rodzaj rynku | Nazwa rynku | Emitent (wystawca) | Kraj siedziby emitenta (wystawcy) | Instrument bazowy | Liczba |
|----------------------|--------------|-------------|--------------------|-----------------------------------|-------------------|--------|
| | | | | | | |

| |
|-------------------------------------|
| Procentowy udział w aktywach ogółem |
| 0,07 |
| 0,04 |
| 0,24 |
| 0,12 |
| 0,09 |
| 0,07 |
| 0,03 |
| 0,04 |
| 0,06 |
| 0,06 |
| 0,19 |
| 0,17 |
| 0,06 |
| 0,04 |
| 0,12 |
| 0,41 |
| 0,13 |
| 0,36 |
| 0,31 |
| 0,05 |

| Wartość nominalna | Liczba | Wartość według ceny nabycia w tys. | Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys. | Procentowy udział w aktywach ogółem |
|-------------------|--------|------------------------------------|---|-------------------------------------|
| | 16 285 | 16 424 | 16 513 | 87,94 |
| | 16 285 | 16 424 | 16 513 | 87,94 |
| 1 000,00 | 16 285 | 16 424 | 16 513 | 87,94 |

| Wartość według ceny nabycia w tys. | Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys. | Procentowy udział w aktywach ogółem |
|------------------------------------|---|-------------------------------------|
|------------------------------------|---|-------------------------------------|

| I. Wystandaryzowane instrumenty pochodne: | | | | | | | 10 |
|---|----------------------------------|---|--|-----------------------|--------------|--|----|
| 1. FUTURES, Indeks WIG20, FW20Z1720, 2017-12-15 (PLOGF0012302) - pozycja krótka | Aktywny Rynek - Rynek Regulowany | Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie | Giełda Papierów Wartościowych w Warszawie S.A. | Rzeczpospolita Polska | Indeks WIG20 | | 10 |

| NIERUCHOMOŚCI | Rok oddania do użytku | Data nabycia | Numer księgi wieczystej | Kraj położenia | Adres | Powierzchnia | Obciążenia |
|---------------|-----------------------|--------------|-------------------------|----------------|-------|--------------|------------|
| | | | | | | | |

TABELŁODATKOWE

| GWARANTOWANE SKŁADNIKI LOKAT | Rodzaj | Łączna liczba | Wartość według ceny nabycia w tys. | Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys. | Procentowy udział w aktywach ogółem |
|--|-------------|---------------|------------------------------------|---|-------------------------------------|
| 1. Papiery wartościowe gwarantowane przez Skarb Państwa | nie dotyczy | | | | |
| 2. Papiery wartościowe gwarantowane przez NBP | nie dotyczy | | | | |
| 3. Papiery wartościowe gwarantowane przez jednostki samorządu terytorialnego | nie dotyczy | | | | |
| 4. Papiery wartościowe gwarantowane przez państwa należące do OECD (z wyłączeniem Rzeczypospolitej Polskiej) | nie dotyczy | | | | |
| 5. Papiery wartościowe gwarantowane przez międzynarodowe instytucje finansowe, których członkiem jest Rzeczpospolita Polska lub przynajmniej jedno z państw należących do OECD | nie dotyczy | | | | |

| INSTRUMENTY RYNKU PIENIĘŻNEGO | Emitent | Termin wykupu | Warunki oprocentowania | Wartość nominalna | Liczba | Wartość według ceny nabycia w tys. | Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys. |
|-------------------------------|---------|---------------|------------------------|-------------------|--------|------------------------------------|---|
| 1. nie dotyczy | | | | | | | |

| GRUPY KAPITAŁOWE, O KTÓRYCH MOWA W ART. 98 USTAWY | Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys. | Procentowy udział w aktywach ogółem |
|---|---|-------------------------------------|
| 1. Grupa PZU | 71 | 0,38 |

| SKŁADNIKI LOKAT NABYTE OD PODMIOTÓW, O KTÓRYCH MOWA W ART. 107 USTAWY | Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys. | Procentowy udział w aktywach ogółem |
|---|---|-------------------------------------|
| 1. nie dotyczy | | |

| PAPIERY WARTOŚCIOWE EMITOWANE PRZEZ MIĘDZYNARODOWE INSTYTUCJE FINANSOWE, KTÓRYCH CZŁONKIEM JEST RZECZPOSPOLITA POLSKA LUB PRZYNAJMNIEJ JEDNO Z PAŃSTW NALEŻĄCYCH DO OECD | Nazwa emitenta | Kraj siedziby emitenta | Rodzaj rynku | Nazwa rynku | Liczba | Wartość według ceny nabycia w tys. |
|--|----------------|------------------------|--------------|-------------|--------|------------------------------------|
| 1. nie dotyczy | | | | | | |

| | | |
|---|---|------|
| 0 | 0 | 0,00 |
| 0 | 0 | 0,00 |

| Służebności | Wartość według ceny nabycia w tys. | Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys. | Procentowy udział w aktywach ogółem |
|-------------|------------------------------------|---|-------------------------------------|
| | | | |

| |
|-------------------------------------|
| Procentowy udział w aktywach ogółem |
| |

| Wartość według wyceny na dzień bilansowy w tys. | Procentowy udział w aktywach ogółem |
|---|-------------------------------------|
| | |

| BILANS | 3 kwartał | | 2 kwartał | | 2016 rok | 3 kwartał 2016 roku |
|--|-----------|------|-----------|------|----------|------------------------|
| | 2017 | roku | 2017 | roku | | |
| I. Aktywa | 18 777 | | 19 169 | | 20 470 | 21 255 |
| 1. Środki pieniężne i ich ekwiwalenty | 1 757 | | 1 345 | | 1 011 | 1 534 |
| 2. Należności | 2 | | 3 | | 0 | 91 |
| 3. Transakcje przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu | 0 | | 0 | | 0 | 0 |
| 4. Składniki lokat notowane na aktywnym rynku, w tym: | 17 010 | | 17 807 | | 19 459 | 19 622 |
| - dłużne papiery wartościowe | 16 513 | | 17 339 | | 19 059 | 19 272 |
| 5. Składniki lokat nienotowane na aktywnym rynku, w tym: | 0 | | 0 | | 0 | 0 |
| - dłużne papiery wartościowe | 0 | | 0 | | 0 | 0 |
| 6. Nieruchomości | 0 | | 0 | | 0 | 0 |
| 7. Pozostałe aktywa | 8 | | 14 | | 0 | 8 |
| II. Zobowiązania | 30 | | 32 | | 33 | 34 |
| III. Aktywa netto (I-II) | 18 747 | | 19 137 | | 20 437 | 21 221 |
| IV. Kapitał funduszu | -10 059 | | -9 664 | | -8 308 | -7 614 |
| 1. Kapitał wpłacony | 349 986 | | 349 986 | | 349 986 | 349 986 |
| 2. Kapitał wypłacony (wielkość ujemna) | -360 045 | | -359 650 | | -358 294 | -357 600 |
| V. Dochody zatrzymane | 28 695 | | 28 721 | | 28 772 | 28 790 |
| 1. Zakumulowane, nierozdysonowane przychody z lokat netto | 18 589 | | 18 572 | | 18 540 | 18 523 |
| 2. Zakumulowany, nierozdysonowany zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat | 10 106 | | 10 149 | | 10 232 | 10 267 |
| VI. Wzrost (spadek) wartości lokat w odniesieniu do ceny nabycia | 111 | | 80 | | -27 | 44 |
| VII. Kapitał funduszu i zakumulowany wynik z operacji (IV+V+/-VI) | 18 747 | | 19 137 | | 20 437 | 21 221 |

| | | | | |
|---|---------|---------|---------|---------|
| Liczba zarejestrowanych certyfikatów inwestycyjnych | 155 106 | 158 375 | 169 612 | 175 353 |
| Wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny | 120,87 | 120,83 | 120,49 | 121,02 |

| | |
|--|---------|
| Przewidywana liczba certyfikatów inwestycyjnych | 152 676 |
| Rozwodniona wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny | 120,87 |

| |
|--|
| Liczba certyfikatów inwestycyjnych w podziale na serie certyfikatów: |
| Liczba certyfikatów inwestycyjnych serii A: 155 106 szt. |

| |
|---|
| Wartość aktywów netto na poszczególne serie certyfikatów inwestycyjnych: |
| Wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny serii A: 120,87 zł. |
| Dłużne papiery wartościowe prezentowane są łącznie z odsetkami. |
| Fundusz prezentuje lokaty overnight w pozycji "środki pieniężne". |
| Niezrealizowany zysk lub strata z wyceny kontraktów terminowych jest prezentowany w pozycji "środki pieniężne". |

Narastająco
kwartały roku
bieżącego
kwartał:
rok:
od:
do:

Okres roku
poprzedniego
od:
do:

Narastająco
kwartały roku
poprzedniego
kwartał:
rok:
od:
do:

| RACHUNEK WYNIKU Z OPERACJI | od 2017-07-01 | 3 2017 | 2016-07-01 | 3 2016 |
|--|---------------|--------------------------|------------|--------------------------|
| | do 2017-09-30 | 2017-01-01 2017-09-30 | 2016-09-30 | 2016-01-01 2016-09-30 |
| I. Przychody z lokat | 114 | 342 | 131 | 399 |
| 1. Dywidendy i inne udziały w zyskach | 6 | 10 | 6 | 11 |
| 2. Przychody odsetkowe | 109 | 332 | 125 | 388 |
| 3. Przychody związane z posiadaniem nieruchomości | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 4. Dodatnie saldo różnic kursowych | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 5. Pozostałe | 0 | 0 | 0 | 0 |
| II. Koszty funduszu | 97 | 293 | 111 | 338 |
| 1. Wynagrodzenie dla towarzystwa | 86 | 261 | 98 | 305 |
| 2. Wynagrodzenia dla podmiotów prowadzących dystrybucję | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 3. Opłaty dla depozytariusza | 2 | 6 | 2 | 6 |
| 4. Opłaty związane z prowadzeniem rejestru aktywów funduszu | 5 | 14 | 5 | 15 |
| 5. Opłaty za zezwolenia oraz rejestracyjne | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 6. Usługi w zakresie rachunkowości | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 7. Usługi w zakresie zarządzania aktywami funduszu | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 8. Usługi prawne | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 9. Usługi wydawnicze, w tym poligraficzne | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 10. Koszty odsetkowe | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 11. Koszty związane z posiadaniem nieruchomości | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 12. Ujemne saldo różnic kursowych | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 13. Pozostałe | 4 | 12 | 5 | 12 |
| III. Koszty pokrywane przez towarzystwo | 0 | 0 | 0 | 0 |
| IV. Koszty funduszu netto (II-III) | 97 | 293 | 111 | 338 |
| V. Przychody z lokat netto (I-IV) | 17 | 49 | 20 | 61 |
| VI. Zrealizowany i niezrealizowany zysk (strata) | -12 | 12 | -68 | -117 |
| 1. Zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat, w tym: | -43 | -126 | -5 | -13 |
| - z tytułu różnic kursowych | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2. Wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat, w tym: | 32 | 138 | -63 | -104 |
| - z tytułu różnic kursowych | 0 | 0 | 0 | 0 |
| VII. Wynik z operacji | 6 | 61 | -48 | -56 |

| | | | | |
|--|------|------|-------|-------|
| Wynik z operacji przypadający na certyfikat inwestycyjny | 0,04 | 0,39 | -0,27 | -0,32 |
| Rozwodniony wynik z operacji przypadający na certyfikat inwestycyjny | 0,04 | 0,39 | -0,27 | -0,32 |

Narastająco
kwartały roku
bieżącego
kwartał:
rok:
od:
do:

Okres roku
poprzedniego
od:
do:

Narastająco
kwartały roku
poprzedniego
kwartał:
rok:
od:
do:

| ZESTAWIENIE ZMIAN W AKTYWACH NETTO | od 2017-07-01 | 3 2017 | 2016-01-01 | 3 2016 |
|--|---------------|--------------------------|------------|--------------------------|
| | do 2017-09-30 | 2017-01-01 2017-09-30 | 2016-09-30 | 2016-01-01 2016-09-30 |
| I. Zmiana wartości aktywów netto | -389 | -1 690 | -3 214 | -2 430 |
| 1. Wartość aktywów netto na koniec poprzedniego okresu sprawozdawczego | 19 137 | 20 437 | 23 651 | 23 651 |
| 2. Wynik z operacji za okres sprawozdawczy (razem), w tym: | 6 | 61 | -146 | -56 |
| a) przychody z lokat netto | 17 | 49 | 78 | 61 |
| b) zrealizowany zysk (strata) ze zbycia lokat | -43 | -126 | -48 | -13 |
| c) wzrost (spadek) niezrealizowanego zysku (straty) z wyceny lokat | 32 | 138 | -175 | -104 |
| 3. Zmiana w aktywach netto z tytułu wyniku z operacji | 6 | 61 | -146 | -56 |
| 4. Dystrybucja dochodów (przychodów) funduszu (razem) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| a) z przychodów z lokat netto | 0 | 0 | 0 | 0 |
| b) ze zrealizowanego zysku ze zbycia lokat | 0 | 0 | 0 | 0 |
| c) z przychodów ze zbycia lokat | 0 | 0 | 0 | 0 |

| | | | | |
|---|------------|------------|------------|------------|
| 5. Zmiany w kapitale w okresie sprawozdawczym (razem), w tym: | -395 | -1 750 | -3 068 | -2 374 |
| a) zmiana kapitału wpłaconego (powiększenie kapitału z tytułu wydanych certyfikatów inwestycyjnych) | 0 | 0 | 0 | 0 |
| b) zmiana kapitału wypłaconego (zmniejszenie kapitału z tytułu wykupionych certyfikatów inwestycyjnych) | -395 | -1 750 | -3 068 | -2 374 |
| 6. Łączna zmiana aktywów netto w okresie sprawozdawczym | -389 | -1 690 | -3 214 | -2 430 |
| 7. Wartość aktywów netto na koniec okresu sprawozdawczego | 18 747 | 18 747 | 20 437 | 21 221 |
| 8. Średnia wartość aktywów netto w okresie sprawozdawczym | 18 874 | 19 365 | 22 143 | 22 618 |
| II. Zmiana liczby certyfikatów inwestycyjnych | 3 269 | 14 506 | 25 303 | 19 562 |
| 1. Zmiana liczby certyfikatów inwestycyjnych w okresie sprawozdawczym: | 3 269 | 14 506 | 25 303 | 19 562 |
| a) liczba wydanych certyfikatów inwestycyjnych | 0 | 0 | 0 | 0 |
| b) liczba wykupionych certyfikatów inwestycyjnych | 3 269 | 14 506 | 25 303 | 19 562 |
| c) saldo zmian | -3 269 | -14 506 | -25 303 | -19 562 |
| 2. Liczba certyfikatów inwestycyjnych narastająco od początku działalności funduszu, w tym: | 155 106 | 155 106 | 169 612 | 175 353 |
| a) liczba wydanych certyfikatów inwestycyjnych | 3 499 861 | 3 499 861 | 3 499 861 | 3 499 861 |
| b) liczba wykupionych certyfikatów inwestycyjnych | 3 344 755 | 3 344 755 | 3 330 249 | 3 324 508 |
| c) saldo zmian | 155 106 | 155 106 | 169 612 | 175 353 |
| 3. Przewidywana liczba certyfikatów inwestycyjnych | 152 676 | 152 676 | 163 164 | 169 612 |
| III. Zmiana wartości aktywów netto na certyfikat inwestycyjny | 0,04 | 0,38 | -0,85 | -0,32 |
| 1. wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny na koniec poprzedniego okresu sprawozdawczego | 120,83 | 120,49 | 121,34 | 121,34 |
| 2. wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny na koniec bieżącego okresu sprawozdawczego | 120,87 | 120,87 | 120,49 | 121,02 |
| 3. procentowa zmiana wartości aktywów netto na certyfikat inwestycyjny w okresie sprawozdawczym | 0,03 | 0,31 | -0,70 | -0,26 |
| 4. minimalna wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny w okresie sprawozdawczym | 120,81 | 120,58 | 120,49 | 121,02 |
| - data wyceny | 2017-07-31 | 2017-02-28 | 2016-12-30 | 2016-09-30 |
| 5. maksymalna wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny w okresie sprawozdawczym | 120,92 | 120,92 | 121,80 | 121,80 |
| - data wyceny | 2017-08-31 | 2017-08-31 | 2016-02-29 | 2016-02-29 |
| 6. wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny według ostatniej wyceny w okresie sprawozdawczym | 120,87 | 120,87 | 120,49 | 121,02 |
| - data wyceny | 2017-09-30 | 2017-09-30 | 2016-12-30 | 2015-09-30 |
| 7. Rozwodniona wartość aktywów netto na certyfikat inwestycyjny | 120,87 | 120,87 | 120,49 | 121,02 |
| IV. Procentowy udział kosztów funduszu w średniej wartości aktywów netto, w tym: | 0,51 | 1,52 | 2,00 | 1,49 |
| 1. procentowy udział wynagrodzenia dla towarzystwa | 0,45 | 1,35 | 1,80 | 1,35 |
| 2. procentowy udział wynagrodzenia dla podmiotów prowadzących dystrybucję | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 3. procentowy udział opłat dla depozytariusza | 0,01 | 0,03 | 0,04 | 0,03 |
| 4. procentowy udział opłat związanych z prowadzeniem rejestru aktywów funduszu | 0,03 | 0,07 | 0,09 | 0,07 |
| 5. procentowy udział opłat za usługi w zakresie rachunkowości | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 6. procentowy udział opłat za usługi w zakresie zarządzania aktywami funduszu | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

Narastająco
kwartały roku
bieżącego
kwartał:
rok:
od:
do:

Okres roku
poprzedniego
od:
do:

Narastająco
kwartały roku
poprzedniego
kwartał:
rok:
od:
do:

| RACHUNEK PRZEPIŹYWÓW PIENIĘŻNYCH | od 2017-07-01 | 3 2017 | 2016-07-01 | 3 2016 |
|--|---------------|--------------------------|------------|--------------------------|
| | do 2017-09-30 | 2017-01-01 2017-09-30 | 2016-09-30 | 2016-01-01 2016-09-30 |
| A. Przepływy środków pieniężnych z działalności operacyjnej | 808 | 2 496 | 1 942 | 2 435 |
| I. Wpływy | 36 520 | 38 700 | 2 133 | 3 107 |
| 1. Z tytułu posiadanych lokat | 414 | 415 | 481 | 482 |
| 2. Z tytułu zbycia składników lokat | 36 102 | 38 275 | 1 648 | 2 608 |
| 3. Pozostałe | 4 | 10 | 4 | 17 |
| a) w tym odsetki od lokat i rachunków bankowych | 4 | 10 | 4 | 10 |
| II. Wydatki | 35 712 | 36 204 | 191 | 671 |
| 1. Z tytułu posiadanych lokat | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2. Z tytułu nabycia składników lokat | 35 620 | 35 900 | 85 | 322 |
| 3. Z tytułu wypłaconego wynagrodzenia dla towarzystwa | 86 | 264 | 100 | 310 |
| 4. Z tytułu wypłaconego wynagrodzenia dla podmiotów prowadzących dystrybucję | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 5. Z tytułu opłat dla depozytariusza | 2 | 6 | 1 | 5 |
| 6. Z tytułu opłat związanych z prowadzeniem rejestru aktywów funduszu | 0 | 19 | 0 | 20 |

| | | | | |
|---|--------------|---------------|---------------|---------------|
| 7. Z tytułu opłat za zezwolenia oraz opłat rejestracyjnych | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 8. Z tytułu usług w zakresie rachunkowości | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 9. Z tytułu usług w zakresie zarządzania aktywami funduszu | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 10. Z tytułu usług prawnych | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 11. Z tytułu posiadania nieruchomości | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 12. Pozostałe | 4 | 15 | 4 | 15 |
| B. Przepływy środków pieniężnych z działalności finansowej | -395 | -1 750 | -1 404 | -2 374 |
| I. Wpływy | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 1. Z tytułu wydania certyfikatów inwestycyjnych | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 2. Z tytułu zaciągniętych kredytów | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 3. Z tytułu zaciągniętych pożyczek | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 4. Z tytułu spłaty udzielonych pożyczek | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 5. Odsetki | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 6. Pozostałe | 0 | 0 | 0 | 0 |
| II. Wydatki | 395 | 1 750 | 1 404 | 2 374 |
| 1. Z tytułu wykupienia certyfikatów inwestycyjnych | 395 | 1 750 | 1 404 | 2 374 |
| 2. Z tytułu spłat zaciągniętych kredytów | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 3. Z tytułu spłat zaciągniętych pożyczek | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 4. Z tytułu wyemitowanych obligacji | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 5. Z tytułu wypłaty przychodów | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 6. Z tytułu udzielonych pożyczek | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 7. Odsetki | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 8. Pozostałe | 0 | 0 | 0 | 0 |
| C. Skutki zmian kursów wymiany środków pieniężnych i ekwiwalentów środków pieniężnych | 0 | 0 | 0 | 0 |
| D. Zmiana stanu środków pieniężnych netto (A+/-B) | 413 | 746 | 538 | 62 |
| E. Środki pieniężne i ekwiwalenty środków pieniężnych na początek okresu sprawozdawczego | 1 345 | 1 011 | 996 | 1 472 |
| F. Środki pieniężne i ekwiwalenty środków pieniężnych na koniec okresu sprawozdawczego (E+/-D) | 1 757 | 1 757 | 1 534 | 1 534 |

NOTY

NOTA-1POLITYKARACHUNKOWOŚCI

| Plik | Opis |
|----------------------|------|
| Nota 1RB FIZ_BI5.rtf | |

| NOTA-2NALEŻNOŚCIFUNDUSZU | 3 kwartał |
|---|-----------|
| | 2017 roku |
| 1. Z tytułu zbytych lokat | 0 |
| 2. Z tytułu instrumentów pochodnych | 0 |
| 3. Z tytułu wydanych certyfikatów inwestycyjnych | 0 |
| 4. Z tytułu dywidendy | 2 |
| 5. Z tytułu odsetek | 0 |
| 6. Z tytułu posiadanych nieruchomości, w tym czynszów | 0 |
| 7. Z tytułu udzielonych pożyczek | 0 |
| 8. Pozostałe | 0 |

| NOTA-3ZOBOWIĄZANIA FUNDUSZU | 3 kwartał |
|---|-----------|
| | 2017 roku |
| 1. Z tytułu nabytych aktywów | 0 |
| 2. Z tytułu transakcji przy zobowiązaniu się funduszu do odkupu | 0 |
| 3. Z tytułu instrumentów pochodnych | 0 |
| 4. Z tytułu wpłat na certyfikaty inwestycyjne | 0 |
| 5. Z tytułu wykupionych certyfikatów inwestycyjnych | 0 |
| 6. Z tytułu wypłaty dochodów funduszu | 0 |
| 7. Z tytułu wypłaty przychodów funduszu | 0 |

| | |
|---|----|
| 8. Z tytułu wyemitowanych obligacji | 0 |
| 9. Z tytułu krótkoterminowych pożyczek i kredytów | 0 |
| 10. Z tytułu długoterminowych pożyczek i kredytów | 0 |
| 11. Z tytułu gwarancji lub poręczeń | 0 |
| 12. Z tytułu rezerw | 30 |
| 13. Pozostałe zobowiązania | 0 |

INFORMACJA DODATKOWA

| Plik | Opis |
|--|------|
| FBI5_raport_III_kwartal_2017_dodatkowa.rtf | |

PODPISY

| PODPISY OSÓB REPRESENTUJĄCYCH FUNDUSZ | | | |
|--|-----------------|--------------------|--------|
| Data | Imię i Nazwisko | Stanowisko/Funkcja | Podpis |
| 2017-11-03 | TOMASZ STADNIK | PREZES ZARZĄDU | . |
| 2017-11-03 | JAKUB RYBA | WICEPREZES ZARZĄDU | . |