INFORMACJA O TECHNIKACH EFEKTYWNEGO ZARZĄDZANIA PORTFELEM

Podstawa prawna: Wytyczne nr 35 i 40 Europejskiego Urzędu Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych (ESMA) dotyczące funduszy typu ETF i innych kwestii związanych z UCITS.

Fundusz może stosować techniki efektywnego zarządzania portfelami Subfunduszy, tj.:

a) zawierać transakcje przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu (buy-sell-back, sell-buy-back, repo, reverse repo);
b) zawierać umowy mające za przedmiot instrumenty pochodne, w tym niewystandaryzowane instrumenty pochodne;
c) zawierać umowy pożyczek papierów wartościowych, gdzie Fundusz jest stroną udzielającą pożyczki.

Dane dotyczące ekspozycji uzyskanej poprzez techniki efektywnego zarządzania portfelem
Dane te zawarte są Sprawozdaniu Finansowym Subfunduszy
Nota 6 – instrumenty pochodne
Nota 7 – transakcje przy zobowiązaniu się drugiej strony do odkupu oraz pożyczki papierów wartościowych

Dane dotyczące tożsamości kontrahenta (kontrahentów) w ramach technik efektywnego zarządzania portfelem
Dane te zawarte są Sprawozdaniu Finansowym Subfunduszy – Zestawienie Lokat: tabela uzupełniająca

Rodzaj i wartość zabezpieczenia otrzymanego przez Subfundusz na dzień bilansowy w celu zmniejszenia ekspozycji kontrahenta

Subfundusz	Kontrahent	Rodzaj	Wartość

Brak

Dochody wynikające z technik efektywnego zarządzania portfelem w odniesieniu do całego okresu objętego rocznym sprawozdaniem finansowym Funduszu wraz z poniesionymi bezpośrednimi i pośrednimi operacyjnymi kosztami i opłatami

Subfundusz	Wartość dochodów
Rockbridge Neo Akcji	-769 220,00
Rockbridge Neo Akcji Europy Środkowej i Wschodniej	0,00
Rockbridge Neo Akcji Średnich Spółek	75 956,00
Rockbridge Neo Aktywnej Alokacji	140 866,00
Rockbridge Neo Globalnych Innowacji	-946 665,00
Rockbridge Neo Konserwatywny	0,00
Rockbridge Neo Multistrategia	-173 919,50
Rockbridge Neo Obligacji Skarbowych	0,00
Rockbridge Neo Stabilnego Wzrostu	-159 850,00

Warszawa, 26 kwietnia 2023 roku

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Krzysztof Mazurek
Data: 2023.04.26 12:13:53 CEST

Krzysztof Mazurek
Prezes Zarządu
Rockbridge TFI S.A.

Witold Chuść
Wiceprezes Zarządu
Rockbridge TFI S.A.

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Witold Chuść
Data: 2023.04.26 12:18:45 CEST

Piotr Franaszczuk
Wiceprezes Zarządu
Rockbridge TFI S.A.

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Piotr Tadeusz Franaszczuk
Data: 2023.04.26 12:35:26 CEST

Michał Tuczyński
Wiceprezes Zarządu
Rockbridge TFI S.A.

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Michał Tuczyński
Data: 2023.04.26 13:08:03 CEST

Jakub Ryba
Wiceprezes Zarządu
Rockbridge TFI S.A.

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Jakub Ryba
Data: 2023.04.26 12:46:38 CEST