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 Subfundusz Dłużny	-1 433 122,89
Rockbridge Subfundusz Lokata Plus	19 781 827,14
Rockbridge Subfundusz Obligacji	- 2 024 871,14
Rockbridge Subfundusz Obligacji 2	4 008,76
Rockbridge Subfundusz Obligacji Korporacyjnych	- 735 746,32
Rockbridge Subfundusz Stabilnego Wzrostu	7 535,30
Rockbridge Subfundusz Value Leaders	- 895 022,34
Rockbridge Subfundusz Zrównoważony	612 738,51
Rockbridge Subfundusz Akcji	438 560,13
Rockbridge Subfundusz Akcji Małych i Średnich Spółek	2 105 486,71
Rockbridge Subfundusz Gier i Innowacji	35 430,57
Rockbridge Subfundusz Akcji Globalnych	1 062 186,37
Rockbridge Subfundusz Akcji Rynków Wschodzących	104 342,18
Rockbridge Subfundusz Growth Leaders	190 788,91

Warszawa, 17 kwietnia 2023 roku

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Krzysztof Mazurek
Data: 2023.04.17 15:43:06 CEST

Krzysztof Mazurek
Prezes Zarządu

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Witold Chuść
Data: 2023.04.17 15:47:45 CEST

Witold Chuść
Wiceprezes Zarządu

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Piotr Tadeusz Franaszczuk
Data: 2023.04.17 16:33:35 CEST

Piotr Franaszczuk
Wiceprezes Zarządu

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Michał Tuczyński
Data: 2023.04.17 16:04:36 CEST

Michał Tuczyński
Wiceprezes Zarządu

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Jakub Ryba
Data: 2023.04.17 16:12:10 CEST

Jakub Ryba
Wiceprezes Zarządu