Zgodnie z art. 13 Rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2015/2365 z dnia 25 listopada 2015 r. w sprawie przejrzystości transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i ponownego wykorzystania oraz zmiany rozporządzenia (UE) nr 648/2012 (Dz. Urz. UE 23.12.2015 L 337/1), na dzień bilansowy spółka zarządzająca AFI prezentuje poniżej informacje o transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych i o swapach przychodu całkowitego Rockbridge Funduszu Inwestycyjnego Zamkniętego Absolute Return Fixed Income

Dane prezentowane są w tysiącach złotych (tys. PLN) Dane na dzień 2020-12-31

Dane ogólne:

Kwota pożyczonych papierów wartościowych i towarów wyrażona jako odsetek całkowitych aktywów mogących być przedmiotem pożyczki (z wyłączeniem środków pieniężnych i ich ekwiwalentów)	-
Kwota aktywów będących przedmiotem każdego rodzaju transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych oraz przedmiotem swapów przychodu całkowitego (wyrażona jako kwota bezwzględna w walucie przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania i jako odsetek zarządzanych aktywów przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania):	
Kwota bezwzględna w PLN	3 922
Odsetek zarządzanych aktywów	2,39%

Dane dotyczące koncentracji:

10 największych wystawców zabezpieczeń we wszystkich transakcjach finansowanych z użyciem papierów wartościowych i swapach przychodu całkowitego (w podziale na wolumeny papierów wartościowych i towarów otrzymanych jako zabezpieczenie według nazwy/nazwiska wystawcy)	
SKARB PAŃSTWA RZECZYPOSPOLITEJ POLSKIEJ	3 922
10 najważniejszych kontrahentów odrębnie dla poszczególnych rodzajów transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i dla swapów przychodu całkowitego (nazwisko/nazwa kontrahenta oraz wolumen brutto transakcji pozostających do rozliczenia)	
Udzielanie pożyczek papierów wartościowych lub towarów oraz zaciąganie pożyczek papierów wartościowych lub towarów	**-**
Transakcje zwrotna kupno-sprzedaż lub transakcje zwrotna sprzedaż-kupno	**3 922**
IPOPEMA SECURITIES S.A.	3 922
IPOPEMA SECURITIES SA	-
MBANK S.A.	-

Zbiorcze dane dotyczące transakcji:

Udzielanie pożyczek papierów wartościowych lub towarów oraz zaciąganie pożyczek papierów wartościowych lub towarów	
Rodzaj i jakość zabezpieczeń	**-**
Okres zapadalności zabezpieczeń w podziale według następujących klas zapadalności	**-**
Waluta zabezpieczeń	**-**
Okres zapadalności w odniesieniu do transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i do swapów przychodu całkowitego w podziale według następujących klas zapadalności	**-**
Kraj, w którym kontrahenci mają siedziby	**-**
Rozliczenie i rozrachunek	**-**
Transakcja zwrotna kupno-sprzedaż lub transakcja zwrotna sprzedaż-kupno	
Rodzaj i jakość zabezpieczeń	**3 922**
Obligacje skarbowe	3 922
Okres zapadalności zabezpieczeń w podziale według następujących klas zapadalności	**3 922**
od jednego tygodnia do jednego miesiąca	-
od trzech miesięcy do jednego roku	-
powyżej jednego roku	3 922
Waluta zabezpieczeń	**3 922**
PLN	3 922
Okres zapadalności w odniesieniu do transakcji finansowanych z użyciem papierów wartościowych i do swapów przychodu całkowitego w podziale według następujących klas zapadalności	**3 922**
powyżej jednego roku	-
od jednego dnia do jednego tygodnia	3 922
Kraj, w którym kontrahenci mają siedziby	**3 922**
POLSKA	3 922

Zbiorcze dane dotyczące transakcji:

Rozliczenie i rozrachunek	**3 922**
dwustronne	3 922

Dane dotyczące ponownego wykorzystania zabezpieczeń:

Odsetek otrzymanych zabezpieczeń, które są przedmiotem ponownego wykorzystania, w porównaniu z maksymalną kwotą określoną w prospekcie emisyjnym lub w informacjach ujawnianych inwestorom	-
Zyski przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania z tytułu reinwestowanych zabezpieczeń gotówkowych	-

Przechowywanie zabezpieczeń otrzymanych przez przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania:

Liczba i nazwiska/nazwy powierników i kwota aktywów stanowiących zabezpieczenie przechowywanych przez każdego z powierników.	
Liczba powierników	-
Powiernik	**Kwota aktywów stanowiących zabezpieczenie**

Przechowywanie zabezpieczeń udzielonych przez przedsiębiorstwo zbiorowego inwestowania:

Odsetek zabezpieczeń posiadanych na odrębnych rachunkach	-
Odsetek zabezpieczeń posiadanych na wspólnych rachunkach	-
Odsetek zabezpieczeń posiadanych na wszelkich innych rachunkach	-

Dane dotyczące rentowności i kosztów:

	od 2020-01-01 do 2020-12-31			
	Rentowność		**Koszty**	
Udzielanie pożyczek papierów wartościowych lub towarów oraz zaciąganie pożyczek papierów wartościowych lub towarów:	**Kwota**	**Odsetek**	**Kwota**	**Odsetek**
- Przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania	-	-	-	-
- Zarządzający przedsiębiorstwem zbiorowego inwestowania	-	-	-	-
- Strony trzecie (np. tzw. „agent lenders”)	-	-	-	-
Transakcja zwrotna kupno-sprzedaż lub transakcja zwrotna sprzedaż-kupno:	**Kwota**	**Odsetek**	**Kwota**	**Odsetek**
- Przedsiębiorstwa zbiorowego inwestowania	43	100,00%	-	-
- Zarządzający przedsiębiorstwem zbiorowego inwestowania	-	-	-	-
- Strony trzecie (np. tzw. „agent lenders”)	-	-	-	-

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Krzysztof Mazurek
Data: 2021.04.19 15:53:54 CEST

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Witold Chuść
Data: 2021.04.19 15:55:02 CEST

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Piotr Tadeusz Franaszczuk
Data: 2021.04.19 16:00:42 CEST