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	-1 097 911,95
Rockbridge Subfundusz Lokata Plus	-1 499 863,62
Rockbridge Subfundusz Obligacji	-1 295 422,89
Rockbridge Subfundusz Obligacji 2	-723 579,59
Rockbridge Subfundusz Obligacji Korporacyjnych	-244 920,28
Rockbridge Subfundusz Stabilnego Wzrostu	-1 049 596,79
Rockbridge Subfundusz Selektywny	-13 843,58
Rockbridge Subfundusz Zrównoważony	34 601,46
Rockbridge Subfundusz Akcji	79 650,50
Rockbridge Subfundusz Akcji Małych i Średnich Spółek	334 234,51
Rockbridge Subfundusz Gier i Innowacji	-149 765,39
Rockbridge Subfundusz Akcji Globalnych	79 779,37

Rockbridge Subfundusz Akcji Rynków Wschodzących	337 123,59
Rockbridge Subfundusz Rynków Surowcowych	92 652,42

Warszawa, 9 kwietnia 2021 roku

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Krzysztof Mazurek
Data: 2021.04.09 14:53:56 CEST

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Witold Chuść
Data: 2021.04.09 15:11:04 CEST

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Piotr Tadeusz Franaszczuk
Data: 2021.04.09 16:07:55 CEST

Krzysztof Mazurek
Prezes Zarządu

Witold Chuść
Wiceprezes Zarządu

Piotr Franaszczuk
Wiceprezes Zarządu