INFORMACJA DLA KLIENTA ALTERNATYWNEGO FUNDUSZU INWESTYCYJNEGO

ROCKBRIDGE NEO SPECJALISTYCZNY FUNDUSZ INWESTYCYJNY OTWARTY

OKRESOWE UJAWNIENIA

sporządzona na dzień 30 czerwca 2023 r. za okres sprawozdawczy od 1 stycznia – 30 czerwca 2023 r.

Niniejsza informacja sporządzona jest w związku z art. 222 b ustawy z dnia 27 maja 2004 r. o funduszach inwestycyjnych i zarządzaniu alternatywnymi funduszami inwestycyjnymi (tj. Dz.U. z 2023 r., poz. 681z poźn. zm.; „Ustawa"), stosownie do treści Informacji dla Klienta Alternatywnego Funduszu Inwestycyjnego („IDK")

Zakres informacji	*Termin udostępnienia*	*Sposób udostępnienia*
Towarzystwo, na podstawie art. 222b Ustawy z uwzględnieniem art. 108 i art. 109 Rozporządzenia 231/2013[1], udostępnia informacje o: a) udziale procentowym aktywów, które są przedmiotem specjalnych ustaleń w związku z ich niepłynnością, b) zmianach regulacji wewnętrznych dotyczących zarządzania płynnością, c) aktualnym profilu ryzyka oraz systemach zarządzania ryzykiem stosowanych przez podmiot nim zarządzający; d) łącznej wysokości zastosowanej dźwigni finansowej AFI.	Informacje te udostępniane są w terminach publikacji rocznych i półrocznych sprawozdań finansowych Funduszu.	Informacje udostępniane są na stronie internetowej www.rockbridge.pl
Towarzystwo, na podstawie art. 222b Ustawy z uwzględnieniem art. 108 i art. 109 Rozporządzenia 231/2013, udostępnia informacje o: a) zmianach maksymalnego poziomu Dźwigni finansowej AFI, który może być stosowany w imieniu Funduszu, oraz b) prawie do ponownego wykorzystania zabezpieczeń lub gwarancji udzielonej na podstawie porozumienia dotyczącego Dźwigni finansowej AFI.	Informacje te udostępniane są niezwłocznie po wystąpieniu zmiany.	Informacje udostępniane są w trybie aktualizacji IDK na stronie internetowej www.rockbridge.pl

Procentowy udział aktywów, które są przedmiotem specjalnych ustaleń w związku z ich niepłynnością

W Funduszu nie obowiązują specjalne ustalenia w związku z niepłynnością aktywów, tj. szczególne uprawnienia dla inwestorów, regulujące w sposób odmienny uprawnienie do umorzenia certyfikatów na wypadek niepłynności aktywów Funduszu.

[1] *Rozporządzenie Delegowane Komisji (UE) Nr 231/2013 z dnia 19 grudnia 2012 r. uzupełniające dyrektywę Parlamentu Europejskiego i Rady 2011/61/UE w odniesieniu do zwolnień, ogólnych warunków dotyczących prowadzenia działalności, depozytariuszy, dźwigni finansowej, przejrzystości i nadzoru (Dz. Urz. UE L 176 z 10.07.2010, str. 1).*

Informacja o zmianach regulacji wewnętrznych dotyczących zarządzania płynnością

W okresie sprawozdawczym wewnętrzne regulacje dotyczące zarządzania płynnością Funduszu nie podlegały zmianom.

Aktualny profil ryzyka oraz informacja o systemie zarządzania ryzykiem stosowanym przez Towarzystwo

System zarządzania ryzykiem obejmuje wszystkie komórki organizacyjne Towarzystwa. Departament Zarządzania Ryzykiem odpowiedzialny za nadzór nad systemem zarządzania ryzykiem podlega bezpośrednio Zarządowi a także przedstawia regularne sprawozdania Radzie Nadzorczej Towarzystwa sprawującej nadzór na systemami kontroli wewnętrznej i zarządzania ryzykiem. System zarządzania ryzykiem działa w oparciu o komitety produktowe a także Komitet Nadzoru, sprawujący nadrzędną rolę w procesie ograniczania ryzyka w Towarzystwie. System zarządzania ryzykiem podlega ocenie biegłego rewidenta przynajmniej raz do roku.

W ramach systemu zarządzania ryzykiem Towarzystwo identyfikuje ryzyka w zarządzanych funduszach i dla wszystkich istotnych czynników ryzyka ustanawia limity wewnętrzne będące uzupełnieniem zapisów statutowych w ramach ograniczania zaangażowania w poszczególne czynniki ryzyka. W szczególności Towarzystwo identyfikuje profil płynności funduszy i ustanawia maksymalne zaangażowania w instrumenty o ograniczonej płynności. System limitów wewnętrznych wspierany przez system alertów ostrzegawczych o charakterze informacyjnym.

Profil ryzyka definiowany jako SRI (Summary Risk Indicator), czyli wskaźnik ryzyka wyliczany w oparciu o metodologię przewidzianą w rozporządzeniu delegowanym Komisji (UE) 2017/653 z dnia 8 marca 2017 r. uzupełniającym rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 1286/2014 w sprawie dokumentów zawierających kluczowe informacje, dotyczących detalicznych produktów zbiorowego inwestowania i ubezpieczeniowych produktów inwestycyjnych (PRIIP) przez ustanowienie regulacyjnych standardów technicznych w zakresie prezentacji, treści, przeglądu i zmiany dokumentów zawierających kluczowe informacje oraz warunków spełnienia wymogu przekazania takich dokumentów (Rozporządzenie PRIIP). Wskaźnik SRI przyjmuje wartość liczby całkowitej z zakresu <1,7>.

Na datę bilansową profil ryzyka poszczególnych subfunduszy wydzielonych w ramach Rockbridge Neo SFIO wyniósł:

Nazwa Subfunduszu	SRI
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Ochrony Wzrostu	2
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Obligacji Plus	2
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Obligacji Światowych	2
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Zrównoważony Azjatycki	3
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Rynków Wschodzących	4
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Rynków Rozwiniętych	4
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Chińskich i Azjatyckich	4
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Amerykańskich	4
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Konserwatywny Plus	2

Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Polskich	4
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Nowa Europa	5
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Małych Spółek	4
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Ameryki Łacińskiej	5
Rockbridge Neo SFIO Subfundusz Akcji Europejskich	4

Łącznej wysokości zastosowanej dźwigni finansowej AFI na dzień bilansowy

Łączna ekspozycja wyznaczona metodą zaangażowania wyniosła na dzień 30 czerwca 2023 r.:

Nazwa Subfunduszu	AFI - ekspozycja obliczona metodą zaangażowania	AFI - ekspozycja obliczona metodą brutto
Rockbridge Neo SFIO Konserwatywny Plus	100,00%	99,25%
Rockbridge Neo SFIO Obligacji Plus	100,00%	99,60%
Rockbridge Neo SFIO Akcji Małych Spółek	105,17%	98,55%
Rockbridge Neo SFIO Ochrony Wzrostu	100,00%	86,25%
Rockbridge Neo SFIO Akcji Nowa Europa	100,65%	125,48%
Rockbridge Neo SFIO Akcji Polskich	100,00%	96,27%
Rockbridge Neo SFIO Obligacji Światowych	98,43%	174,21%
Rockbridge Neo SFIO Akcji Amerykańskich	98,02%	178,40%
Rockbridge Neo SFIO Zrównoważony Azjatycki	98,23%	186,79%
Rockbridge Neo SFIO Akcji Rynków Rozwiniętych	98,18%	190,49%
Rockbridge Neo SFIO Akcji Rynków Wschodzących	97,82%	174,15%
Rockbridge Neo SFIO Akcji Chińskich i Azjatyckich	98,14%	183,77%
Rockbridge Neo SFIO Akcji Europejskich	99,00%	178,34%
Rockbridge Neo SFIO Akcji Ameryki Łacińskiej	98,40%	177,85%

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Michał Tuczyński
Data: 2023.08.30 15:25:02 CEST

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Piotr Tadeusz Franaszczuk
Data: 2023.08.30 15:42:42 CEST

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Jakub Ryba
Data: 2023.08.30 16:01:53 CEST

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Krzysztof Mazurek
Data: 2023.08.30 16:37:05 CEST

Signature Not Verified
Dokument podpisany przez Witold Chuść
Data: 2023.08.30 16:39:46 CEST