

TEB Portföy Yönetimi A.Ş.'nin
Kurucusu Olduğu Serbest Fonlara İlişkin
Serbest Fon Risk Bildirim Formudur

Ekim 2021

Kurucusu Olduğumuz Serbest fonların Fon izahnameleri ile belirlenen Kaldıraç seviyeleri ve Risk limitleri, fonların izahnamelerine uygun olarak yönetilmekte olup belirlenen ve ölçülen değerler aşağıdadır.

| Fon Kodu | Fon Adı | Kaldıraç Oranı % ⁽¹⁾ | Kaldıraç Limiti % ⁽²⁾ | RMD (%) ⁽³⁾ | Risk Değeri ⁽⁴⁾ |
|----------|--|---------------------------------|----------------------------------|------------------------|----------------------------|
| TPJ | TEB Portföy Birinci Serbest (Döviz) Fon | 1 | 200 | 2,21 | 5 |
| TDP | TEB Portföy İkinci Serbest (Döviz) Fon | - | 100 | 2,50 | 5 |
| TTP | TEB Portföy Üçüncü Serbest (Döviz) Fon | - | 100 | 2,38 | 5 |
| TTS | TEB Portföy Dördüncü Serbest (Döviz) Fon | - | 100 | 1,89 | 5 |
| TPP | TEB Portföy Pusula Serbest Fon | 113 | 120 | 2,26 | 5 |
| TMR | TEB Portföy Makro Serbest Fon | 16 | 200 | 0,24 | 3 |
| TRR | TEB Portföy Beşinci Serbest Fon | - | 100 | 0,18 | 2 |

* 31.10.2021 itibarıyla

| Açıklama | |
|----------------------------|---|
| Kaldıraç (1) | Kaldıraç yaratan işlemlere ilişkin olarak araç bazında ayrı ayrı hesaplanan pozisyonların mutlak değerlerinin toplanması (sum of notionals) suretiyle ulaşılan toplam pozisyonun fon toplam değerine oranını ifade etmektedir. |
| Kaldıraç Limiti (2) | Riske Maruz Değer (RMD) yöntemini kullanan fonlar tarafından hesaplanan kaldırıca ilişkin olarak izahnamede belirlenen limittir. |
| RMD (%) (3) | RMD, belirli bir güven aralığında ve ölçüm süresi içinde fon portföyünün kaybedebileceği azami değeri ifade etmektedir. RMD, piyasa fiyatlarındaki hareketler nedeniyle ortaya çıkabilecek belirli varsayımlar altındaki muhtemel zarar seviyesini göstermektedir. RMD günlük olarak, tek taraflı %99 güven aralığında, tarihsel gözlem yöntemi, 20 gün elde tutma süresi ve en az 1 yıllık (250 gün) gözlem süresi kullanılarak hesaplanır. Piyasa riskinin ölçümünde kullanılan bu yöntem, fon portföy değerinin normal piyasa koşulları altında ve belirli bir dönem dahilinde maruz kalabileceği en yüksek zararı belirli bir güven aralığında ifade eden değerdir. Serbest fon olması nedeniyle Fon'un RMD limiti bulunmamaktadır. |
| Risk Değeri (4) | Risk Değeri (RD) Sermaye Piyasası Kurulu tarafından Yatırım Fonları için belirlenmiş bir risk ölçüm yöntemidir. RD, fonun volatilitesi dikkate alınarak hesaplanır. |