

Rota Portföy Yönetimi A.Ş.'nin Kurucusu Olduğu Serbest Fonlara İlişkin Serbest Fon

Risk Bildirim Formu

Nisan 2023

Kurucusu olduğumuz Serbest fonların fon izahnameleri ile belirlenen Kaldıraç seviyeleri ve Risk limitleri, fonların izahnamelerine uygun olarak yönetilmekte olup belirlenen ve ölçülen değerler aşağıda yer almaktadır.

| Fon Kodu | Fon Adı | Kaldıraç Oranı % | Kaldıraç Limiti % | RMD % | Risk Değeri |
|----------|---|------------------|-------------------|-------|-------------|
| RPS | Rota Portföy Birinci Serbest (Döviz) Fon | 13 | 300 | 0,90 | 7 |
| RPN | Rota Portföy Nev Serbest Fon | 94 | 400 | 5,47 | 7 |
| RPT | Rota Portföy İkinci Serbest (TL) Fon | - | 300 | 0,22 | 2 |
| RPX | Rota Portföy Üçüncü Serbest (Döviz) Fon | - | 300 | 1,87 | 6 |
| RDS | Rota Portföy Dördüncü Serbest (Döviz) Fon | - | 300 | 1,63 | 6 |
| RAF | Rota Portföy Altıncı Serbest Fon | 26 | 300 | 2,71 | 6 |
| RBE | Rota Portföy Beşinci Serbest (TL) Fon | - | 300 | - | 2 |

*28.04.2023 itibarı ile

| Açıklama | |
|------------------------|---|
| Kaldıraç Oranı | 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 | Riske Maruz Değer (RMD) yöntemini kullanan fonlar tarafından hesaplanan kaldırıca ilişkin olarak izahnamede belirlenen limittir. |
| RMD (%) | 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 | Risk Değeri (RD) Sermaye Piyasası Kurulu tarafından Yatırım Fonları için belirlenmiş bir risk ölçüm yöntemidir. RD, fonun volatilitesi dikkate alınarak hesaplanır. |