

HSBC Portföy Yönetimi
Serbest Fonlara İlişkin Aylık Risk Bildirim Raporu
Aralık 2020

HSBC Portföy Yönetimi'nin kurucusu olduğu serbest fonlara ilişkin aralık ayı serbest fon risk bildirim raporu aşağıdadır.

Tüm serbest fonlar 01/12/2020 - 31/12/2020 tarihleri arasında kaldıraç seviyeleri ve belirlenen risk limitleri ile uyumludur.

| Fon Kodu | Fon Adı | RMD (%) (1) | Kaldıraç Oranı (%) (2) | Kaldıraç Limiti (%) (3) |
|----------|--|----------------|---------------------------|----------------------------|
| HDB | Hsbc Portföy Birinci Serbest (Döviz) Fon | 2.13% | 9.70% | 500% |

*31/12/2020 değerleri kullanılmıştır.

Açıklamalar

1)RMD (%): Riske maruz değer, fon portföy değerinin normal piyasa koşulları altında ve belirli bir dönem dahilinde maruz kalabileceği en yüksek zararı belirli bir güven aralığında (Hesaplamalarda tek taraflı %99 olarak alınmıştır.) ifade eden orandır.

2)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 eder.

3)Kaldıraç Limiti (%): HSBC Portföy Yönetimi tarafından belirlenen ve fonun izahnamesinde belirtilen kaldıraç limitidir.