

BNP PARİBAS CARDİF EMEKLİLİK A.Ş. OKS MUHAFAZAKAR DEĞİŞKEN EMEKLİLİK YATIRIM FONU Genel Açıklama

Özet Bilgi

BPR Fonun Risk Değeri Hakkında

Genel Açıklama

Genel Açıklama	
Yapılan Açıklama Güncelleme mi?	Hayır (No)
Yapılan Açıklama Düzeltme mi?	Hayır (No)
Konuya İlişkin Daha Önce Yapılan Açıklamanın Tarihi	.
Bildirim İçeriği	
Açıklamalar	

BPR fonun anlık risk değeri 18.09.2020 tarihinden itibaren haftalık bazda (3) değerini almaya başlamış ve belli bir periyod boyunca da bu değeri almaya devam etmiştir

Yatırım Fonlarına İlişkin Rehber'e istinaden Madde 9.3.2.2-2 "Son dört ay içerisinde yapılan hesaplamalar sonucu, fonun RD'sinin birden fazla kategoride yer alması halinde, fonun RD'si, daha sıklıkla yer aldığı kategoriye tekabül eden değerdir "

Bu sebeple fonun risk değeri 13.11.20 tarihli risk raporunda olması gereken değerden (1-2) yüksek (3) olarak çıkmıştır.

Bu yükselişin sebebi bu dönemde fon portföyüne oynaklığı yüksek yatırım araçlarının biraz daha fazla eklenmesi ve bu dönemde yatırım araçlarının piyasa oynaklıklarının da artmış olmasıdır. Her ne kadar bu süreçte yapılan işlemler izahnamede yer alan sınırlamalara tabii olarak gerçekleştirilmiş olsa da risk seviyesi olması gerekenin üzerine çıkmıştır.

Bu durumu düzeltilmesi için fonun taşıdığı riskli varlıkların oranı düşürülmüş ve anlık risk değeri 20.11.2020 tarihinde çekilen risk raporunda da fonun risk değeri (2) olarak kayıtlara geçmiştir ve sonraki süreçte (2) seviyesinin altında kalmaya devam etmiştir.

Bu limitin aşılmaması için gerekli tedbirler alınmış ve ek takip süreçleri planlanmıştır.

Ŗu an itibariyle fon risk deęeri rehber 9.3.2.2-2 nolu maddesine istinaden en ok tekrar eden risk deęerine bakıldığında, gemiŖ dnemdeki oynaklıklardan dolayı, (2) ve (3) risk deęerleri bir sre daha eŖit miktarda grlecek olup, ancak son 1 ayın ortalaması alındığında fonun risk deęeri (2) olarak ortaya ıkmaktadır. nmzdeki dnemde de bir kez daha byle bir aŖımın tekrarlanması beklenmemektedir.