

## Risk Yönetimi

Yönetilen fon ve portföyleri olumsuz yönde etkileyecek risklerin etkin bir biçimde belirlenmesi, ölçülmesi ve çıkabilecek risklerin en alt düzeye indirilmesi Finans Portföy Risk Yönetimi sisteminin ana hedefidir.

Yatırım yönetimi sürecinde risk kavramının tam bilincinde olan Finans Portföy Yönetimi, karar alma süreçlerinde risk yönetiminin tüm aşamalarını entegre eden bir yaklaşım sergilemektedir.

Portföy Yönetimi birimlerinden bağımsız bir yapıda oluşturulmuş olan Risk Yönetimi Birimi, riskleri belirlemek, analiz etmek ve raporlamakla sorumludur. Bu kapsamda yapılan hesaplamalarda uluslararası kabul görmüş risk ölçüm metodolojileri ve rasyoları kullanılmaktadır.

### Finans Portföy Risk Yönetimi felsefesinin ana ilkeleri:

- Piyasa koşullarındaki gelişmeleri yakından izleyerek, yönetilen fon ve portföylerin maruz kalabilecekleri riskleri etkin risk yönetimi ölçüm metodolojileriyle belirleyerek elde edilen getirilerin hangi risk seviyesinde sağlandığını ölçmek ve raporlamak,
- Portföylerin yatırımları nedeniyle maruz kalabileceği risk seviyelerini ölçerek, Risk Komitesi'nce belirlenen ve Yönetim Kurulu Kararı ile alınan risk limitlerine uyumu kontrol etmek, limit aşımı durumunda aşım sürecini takip etmek,
- Uluslararası kabul görmüş risk yönetimi düzenlemelerindeki değişiklikleri ve yenilikleri yakından izleyerek kabul görmüş bir risk yönetimi sistemi oluşturmaya ve geliştirmeye yönelik çalışmaları sürdürmek
- Alınan yatırım kararları doğrultusunda gerekli kontrolleri gerçekleştirmek.

Finans Portföy Risk Yönetim Süreci kapsamında fonların maruz kaldığı riskler günlük periyotta ölçülerek raporlanmaktadır. Her fon özelinde fonun ve kurumun risk iştahına bağlı olarak Risk Komitesi'nce belirlenen limitlere uyum izlenir.

