

## TASARRUF SAHİPLERİNE DUYURU

### NEO PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş. FON SEPETİ ŞEMSIYE FONU'NA BAĞLI NEO PORTFÖY BİRİNCİ FON SEPETİ FONU İZAHNAME DEĞİŞİKLİĞİ

Sermaye Piyasası Kurulu'nun 15/02/2024 tarih ve E-12233903-305.04-49767 sayılı izni doğrultusunda; Neo Portföy Birinci Fon Sepeti Fonu'nun izahnamesinin 2.3. maddesi değiştirilmiştir.

Değişiklikler 05/03/2024 tarihinden itibaren uygulanmaya başlanacaktır.

#### İZAHNAME DEĞİŞİKLİKLERİNİN KONUSU:

1. Varlık dağılımı ve seçiminde kullanılan algoritma ile ilgili dışarıdan alınan hizmete ilişkin danışmanlık sözleşmesinin sona ermesi nedeniyle, Fon izahnamesinin 2.3. numaralı maddesinden, söz konusu algoritmaya, kullanılan modele ve ilgili danışman firmaya ilişkin ifadeler çıkartılmış ve bunun yerine "Fonun içerisinde yatırım yapılacak varlık sınıflarının seçimi ve fon ağırlıklarının belirlenmesi sürecinde yapay zeka tabanlı portföy optimizasyon modeli Magnus çıktıları baz alınır. Varlıkların geçmiş fiyatları, rakip varlıkların geçmiş fiyatları, makro ekonomik göstergeler (büyüme, enflasyon, faiz oranları, işsizlik vb.), mikro ekonomik göstergeler (piyasa değeri vb.), piyasa verileri (döviz kurları vb.), teknik analiz indikatörleri (momentum, volatilité, hacim, trend vb.), finansal modeller (Ortalama Varyans Portföy Optimizasyonu vb.), optimizasyon amaç fonksiyonları (Sharpe vb.), optimizasyon kısıtları (varlık ağırlık kısıtları vb.) ve istatistiksel modeller (Kovaryans Matrisi vb.) kullanılarak optimal portföy oluşturulur. Fonun içerisindeki varlık dağılımları ve fon ağırlıklarının piyasa koşullarına göre kontrolü sağlanır. Portföyde güncelleme önerileri periyot ve eşik değeri bazlı yapılır. Piyasa koşulları ve portföy yöneticisi görüşleri doğrultusunda daha sık periyotlarda portföyde değişiklik yapılabilir. Nihai yatırım kararı ve uygulaması yetki ve sorumluluğu portföy yöneticisindedir." ifadeleri eklenmiştir.

Değişikliklere ilişkin detaylı bilgilere, fonun Kamuyu Aydınlatma Platformu'nda (www.kap.org.tr) yayımlanan izahname tadil metninden ulaşılabilir.

