

Deniz Portföy Nil Serbest (Döviz) Özel Fon

**1 Ocak - 30 Haziran 2018 ara hesap dönemine ait
performans sunuş raporu ve yatırım performansı
konusunda kamuya açıklanan bilgilere ilişkin rapor**

Deniz Portföy Nil Serbest (Döviz) Özel Fonu'nun yatırım performansı konusunda kamuya açıklanan bilgilere ilişkin rapor

Deniz Portföy Nil Serbest (Döviz) Özel Fonu'nun ("Fon") 1 Ocak - 30 Haziran 2018 hesap dönemine ait ekteki performans sunuş raporunu Sermaye Piyasası Kurulu'nun Seri: VII-128.5 sayılı Bireysel Portföylerin ve Kolektif Yatırım Kuruluşlarının Performans Sunumu'na, Performans Dayalı Ücretlendirilmesine ve Kolektif Yatırım Kuruluşlarını Notlandırma ve Sıralama Faaliyetlerine İlişkin Esaslar Hakkında Tebliği'nde ("Tebliğ") yer alan performans sunuş standartlarına ilişkin düzenlemeleri çerçevesinde incelemiş bulunuyoruz.

İncelememiz sonucunda Fon'un 1 Ocak – 30 Haziran 2018 hesap dönemine ait performans sunuş raporunun Tebliğ'de belirtilen performans sunuş standartlarına ilişkin düzenlemelerine uygun hazırlamadığı kanaatine varmamıza sebep olacak herhangi bir tespitimiz bulunmamaktadır.

Diğer Husus

1 Ocak – 30 Haziran 2018 dönemine ait performans sunuş raporunda sunulan ve performans bilgisi hesaplamalarına dayanak teşkil eden finansal bilgiler Türkiye Bağımsız Denetim Standartları'na (BDS) uygun olarak tam veya sınırlı kapsamlı denetime tabi tutulmamıştır.

Güney Bağımsız Denetim ve Serbest Muhasebeci Mali Müşavirlik Anonim Şirketi
A member firm of Ernst&Young Global Limited



20 Temmuz 2018
İstanbul, Türkiye

Deniz Portföy Nil Serbest (Döviz) Özel Fon'NA AİT PERFORMANS SUNUM RAPORU**A. TANITICI BİLGİLER**

PORTFÖYE BAKIŞ
Halka Arz Tarihi : 28.06.2018

YATIRIM VE YÖNETİME İLİŞKİN BİLGİLER

29.06.2018 tarihi itibarıyla	
Fon Toplam Değeri	6,580,469
Birim Pay Değeri (TRL)	4.538254
Yatırımcı Sayısı	1
Tedavül Oranı (%)	1.45%
Portföy Dağılımı	
Borçlanma Araçları	99.61%
- Özel Sektör Borçlanma Araçları	99.61%
Vadeli Mevduat	0.40%

Fon'un Yatırım Amacı	Portföy Yöneticileri
Özel fon olmasından dolayı Fon izahnamesinde belirtilen kişiler tarafından alım satım yapılabilmektedir.	SERKAN TÜRK
En Az Alınabilir Pay Adedi : 1 Adet	
Yatırım Stratejisi	
Fon portföyüne alınacak finansal varlıklar Sermaye Piyasası Kurulu'nun düzenlemelerine ve izahnamesinde belirtilen esaslara uygun olarak seçilir ve portföy yöneticisi tarafından mevzuata uygun olarak yönetilir.	
Yatırım Riskleri	
Faiz Riski: Piyasa faizlerindeki ani değişiklikler sebebiyle oluşan risktir.Kredi Riski: Tahvil ve Bono ihraç eden kuruluşların anapara ve faiz geri ödemelerinde yükümlülüklerini karşılayamamaları sonucunda oluşan risktir.Likidite Riski: Fon portföyünde bulunan varlıkların istenildiği anda piyasa fiyatından nakde dönüştürülememesi halinde ortaya çıkan zarar olasılığı riskidir. Döviz Kuru Riski: Döviz kurlardaki ani dalgalanma nedeniyle oluşan risktir. Kaldıraç Yaratan İşlem Riski: Fon portföyüne türev araç (vadeli işlem ve opsiyon sözleşmeleri), saklı türev araç, swap sözleşmesi, varant, sertifika dahil edilmesi, ileri valörlü tahvil/bono ve altın alım işlemlerinde ve diğer herhangi bir yöntemle kaldıraç yaratan benzeri işlemlerde bulunulması halinde, başlangıç yatırımı ile başlangıç yatırımının üzerinde pozisyon alınması sebebi ile fonun başlangıç yatırımından daha yüksek zarar kaydedebilme olasılığı kaldıraç riskini ifade eder.	

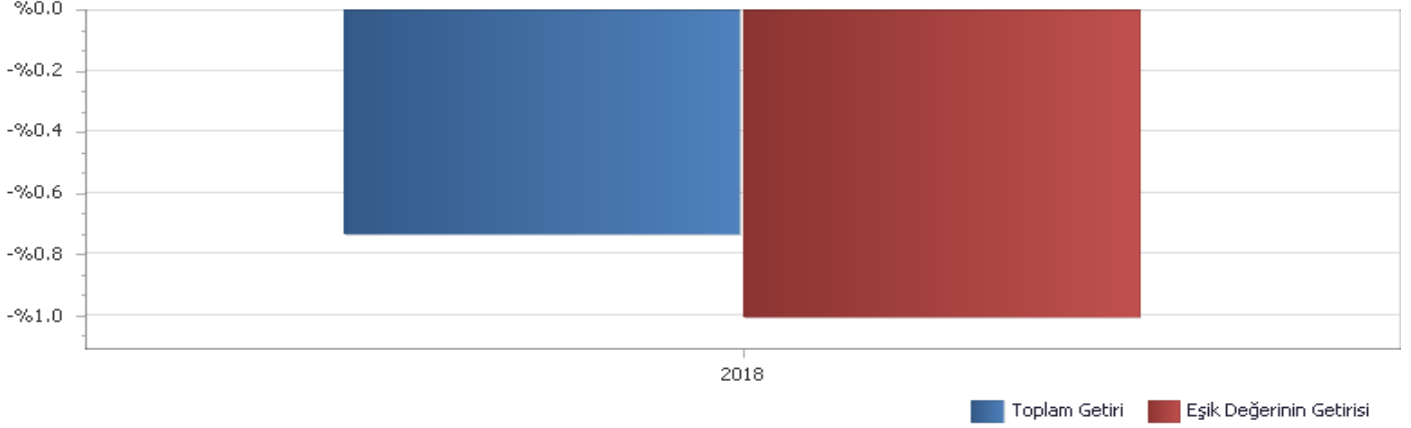
B. PERFORMANS BİLGİSİ

PERFORMANS BİLGİSİ							
YILLAR	Toplam Getiri (%)	Eşik Değer Getirisi (%)	Enflasyon Oranı (%) (TÜFE) (*)	Portföyün Zaman İçinde Standart Sapması (%) (**)	Eşik Değerin Standart Sapması (%) (**)	Bilgi Rasyosu	Sunuma Dahil Dönem Sonu Portföyün Toplam Değeri / Net Aktif Değeri
2018 (**)	-0.736%	-1.007%	0.172%	-	-	-	6,580,468.87

(*) Enflasyon oranı TÜİK tarafından açıklanan 12 aylık TÜFE'nin dönemsel oranıdır.

(**) Portföyün ve eşik değerinin standart sapması dönemindeki günlük getiriler üzerinden hesaplanmıştır.

(***) İlgili veriler 28.06.2018 tarihinden rapor tarihine kadar olan değerleri vermektedir.

PERFORMANS GRAFİĞİ

GEÇMİŞ GETİRİLER GELECEK DÖNEM PERFORMANSI İÇİN BİR GÖSTERGE SAYILMAZ.

C. DİPNOTLAR

1) Deniz Portföy hedeflenen getirinin yanında destek hizmet ve bütüncül yaklaşım ile yatırımcı nezdinde güvenilir ve şeffaf yönetim yapan kurum anlayışını önemsemektedir. Stratejilere yatırım alternatifleri üzerinde temel ve nicel analizlere göre yatırım komitesinin ortak görüş birliğine göre karar verilir.

2) Fon Portföyü'nün yatırım amacı, yatırımcı riskleri ve stratejisi "Tanıtıcı Bilgiler" bölümünde belirtilmiştir.

3) Fon 28.06.2018 - 29.06.2018 döneminde net %-0.74 oranında getiri sağlarken, eşik değerinin getirisi aynı dönemde %-1.01 olmuştur. Sonuç olarak Fon'un nispi getirisi %0.27 olarak gerçekleşmiştir.

Toplam Getiri : Fonun ilgili dönemdeki birim pay değerindeki yüzdesel getiriyi ifade etmektedir.

Eşik Değerinin Getirisi : Fonun eşik değerinin ilgili dönem içerisinde belirtilen varlık dağılımları ile ağırlıklandırarak hesaplanmış olan yüzdesel getirisini ifade etmektedir.

Nispi Getiri : Performans sonu dönemi itibariyle hesaplanan portföy getiri oranı ile karşılaştırma ölçütünün getiri oranı arasındaki farkı ifade etmektedir.

4) Yönetim ücretleri, vergi, saklama ücretleri ve diğer faaliyet giderlerinin günlük brüt portföy değerine oranının ağırlıklı ortalaması aşağıdaki gibidir.

28.06.2018 - 29.06.2018 döneminde :	Portföy Değerine Oranı (%)	TL Tutar
Fon Yönetim Ücreti	0.001258%	166.13
Denetim Ücreti Giderleri	0.000879%	116.12
Saklama Ücreti Giderleri	0.000345%	45.52
Aracılık Komisyonu Giderleri	0.000000%	0.00
Kurul Kayıt Ücreti	0.000082%	10.85
Diğer Faaliyet Giderleri	0.000568%	75.04
Toplam Faaliyet Giderleri	413.66	
Ortalama Fon Toplam Değeri	6,604,872.29	
Toplam Faaliyet Giderleri / Ortalama Fon Toplam Değeri	0.006263%	

5) Performans sunum döneminde Fon'a ilişkin yatırım stratejisi değişikliği yapılmamıştır.

Kıstas Dönemi	Kıstas Bilgisi
28.06.2018-...	%100 BIST-KYD 1 Aylık Mevduat USD (TL) Endeksi + 1.0 (28/06/2018)

6) Yatırım fonlarının portföy işletmesinden doğan kazançları kurumlar vergisi ve stopajdan muaftır.

D. İLAVE BİLGİLER VE AÇIKLAMALAR

1) Tüm dönemler için portföy ve eşik değerinin birikimli getiri oranı

Dönemler	Portföy Net Getiri	Portföy Brüt Getiri	Eşik Değeri	Nispi Getiri
28.06.2018 - 29.06.2018	-0.74%	-0.74%	-1.01%	0.27%

2) Döviz Kurlarındaki Dönemsel Ortalama Getiri ve Sapma

	USD		EUR		GBP		JPY	
Dönemler	Ortalama	Standart Sapma	Ortalama	Standart Sapma	Ortalama	Standart Sapma	Ortalama	Standart Sapma
28.06.2018 - 29.06.2018	-0.80%	0.32%	-0.81%	0.56%	-1.07%	0.55%	-1.15%	0.32%

3) Portföy ve Karşılaştırma Ölçütü / Eşik Değeri için Risk Ölçümleri

Dönemler	Takip Hatası	Beta
28.06.2018 - 29.06.2018	-	-

4) Performans bilgisi tablosunda rapor dönemi portföy ve karşılaştırma ölçütü / eşik değeri standart sapmasına yer verilmiştir. (Günlük verilerden hareketle hesaplanmıştır)

	Portföy		Eşik Değeri	
Yıllar	Getiri	Standart Sapma	Getiri	Standart Sapma
2018	-0.74%	-	-1.01%	-

5) Yatırım Fonu Endeksleri Karşılaştırma Tablosu

Dönemler	Portföy	Yatırım Fonu Endeksleri
28.06.2018 - 29.06.2018	-0.74%	0.06%

6) Getiri Oranını Etkileyen Piyasa Koşulları

28.06.2018 - 29.06.2018 Dönem Getirisi	Getiri
BIST 100 ENDEKSİ	0.30%
BIST 30 ENDEKSİ	0.02%
BIST-KYD REPO BRÜT ENDEKSİ	0.15%
BIST-KYD DİBS 91 GÜN ENDEKSİ	0.03%
BIST-KYD DİBS 182 GÜN ENDEKSİ	0.03%
BIST-KYD DİBS 365 GÜN ENDEKSİ	0.05%
BIST-KYD DİBS 547 GÜN ENDEKSİ	0.05%
BIST-KYD DİBS TÜM ENDEKSİ	0.29%
BIST-KYD DİBS UZUN ENDEKSİ	0.54%
BIST-KYD ÖSBA SABİT ENDEKSİ	0.03%
BIST-KYD ÖSBA DEĞİŞKEN ENDEKSİ	0.05%
BIST-KYD Kamu Kira Sertifikaları Endeksi	0.16%
BIST-KYD Özel Sektör Kira Sertifikaları Endeksi	0.04%
BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Mevduat Endeksi (TL)	0.12%
BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Kar Payı TL Endeksi	0.08%
Katılım 50 Endeksi	1.06%
BIST-KYD ALTIN FİYAT AĞIRLIKLILIKLI ORTALAMA	-1.04%
BIST-KYD Eurobond USD (TL)	-0.43%
BIST-KYD Eurobond EUR (TL)	-0.09%
Dolar Kuru	-1.03%
Euro Kuru	-0.41%