

ATA PORTFÖY ANALİZ HİSSE SENEDİ FONU (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON)

YATIRIM PERFORMANSI KONUSUNDA

KAMUYA AÇIKLANAN BİLGİLERE İLİŞKİN RAPOR

Ata Portföy Analiz Hisse Senedi Fonu (Hisse Senedi Yoğun Fon) 'nun ("Fon") 1 Ocak - 30 Haziran 2022 dönemine ait ekteki performans sunuş raporunu Sermaye Piyasası Kurulu'nun V11-128.5 sayılı Bireysel Portföylerin ve Kolektif Yatırım Kuruluşlarının Performans Sunumuna, Performansa 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.

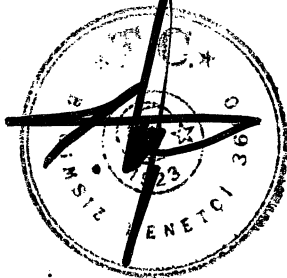
İncelememiz sadece yukarıda belirtilen döneme ait performans sunuşunu kapsamaktadır. Bunun dışında kalan dönemler için inceleme yapılmamış ve görüş oluşturulmamıştır.

Görüşümüze göre Fon'un 1 Ocak – 30 Haziran 2022 dönemine ait performans sunuş raporu Ata Portföy Analiz Hisse Senedi Fonu (Hisse Senedi Yoğun Fon) 'nun performansını ilgili Tebliğin performans sunuş standartlarına ilişkin düzenlemelerine uygun olarak doğru bir biçimde yansıtmaktadır.

Diğer Husus

1 Ocak – 30 Haziran 2022 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 bağımsız denetime tabi tutulmamıştır.

GÜRELİ YEMİNLİ MALİ MÜŞAVİRLİK VE BAĞIMSIZ DENETİM HİZMETLERİ A.Ş.
An Independent Member of BAKER TILLY INTERNATIONAL



İstanbul, 26 Temmuz 2022
Tülin EROL
Sorumlu Denetçi

www.gureli.com.tr

Merkez Ofisi
Spine Tower Maslak Mah. Saat Sok.
No: 5 Kat: 25-26-28
Sarıyer 34485 - İstanbul
T : 444 9 475 (212) 285 01 50
F : +90 (212) 285 03 40-43
gym@gureli.com.tr

Ankara Ofisi
ASO Kule Atatürk Bulvarı
No: 193 Kat: 9
Kavaklıdere 06680 - Ankara
T : +90 (312) 466 84 20
F : +90 (312) 466 84 21
gymankara@gureli.com.tr

Antalya Ofisi
Fener Mah.1964 Sok. No: 36
Kemal Erdoğan Apt. Kat: 1 D: 4
Muratpaşa 07160 - Antalya
T : +90 (242) 324 30 14
F : +90 (242) 324 30 15
gymantalya@gureli.com.tr

Bursa Ofisi
Odunluk Mah. Akademi Cad.
Zeno İş Merkezi D Blok Kat: 7 D: 31
Nilüfer 16265 - Bursa
T : +90 (224) 451 27 10
F : +90 (224) 451 27 79
gymbursa@gureli.com.tr

İzmir Ofisi
Atatürk Cad. Ekim Apt.
No: 174/1 Kat: 5 D: 9
Alsancak 35220 - İzmir
T : +90 (232) 421 21 34
F : +90 (232) 421 21 87
gymizmir@gureli.com.tr

Trakya Ofisi
Yavuz Mah. Ferman Sok.
No: 3/7 Kat: 2
Süleymanpaşa 59100 - Tekirdağ
T : +90 (282) 261 25 30
F : +90 (282) 261 62 56
gymtrakya@gureli.com.tr

ATA PORTFÖY ANALİZ HİSSE SENEDİ FONU (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON)'NA AİT PERFORMANS SUNUM RAPORU
A. TANITICI BİLGİLER

PORTFÖYE BAKIŞ
Halka Arz Tarihi : 11.06.2019

YATIRIM VE YÖNETİME İLİŞKİN BİLGİLER

30.06.2022 tarihi itibarıyla	
Fon Toplam Değeri	31.329.727
Birim Pay Değeri (TRL)	2,715004
Yatırımcı Sayısı	386
Tedavül Oranı (%)	0,01%

Portföy Dağılımı	
Ortaklık Payları	93,94%
- Gayrimenkul Yatırım Ort.	15,14%
- Elektrik	12,01%
- Diğer	9,24%
- Holding	7,73%
- Teknoloji	4,83%
- Gıda	4,36%
- Biracılık Ve Meşrubat	4,29%
- Kağıt Ve Kağıt Ürünleri	4,29%
- İnşaat, Taahhüt	3,92%
- Çimento	3,79%
- Cam	3,74%
- Petrol Ve Petrol Ürünleri	3,53%
- Otomotiv	3,52%
- Hava Yolları Ve Hizmetleri	3,47%
- Endüstriyel Tekstil	3,40%
- Dayanıklı Tüketim	3,35%
- Tarım Kimyasalları	3,34%
Teminat	6,06%
Toplam	100,00%

Fon'un Yatırım Amacı	Portföy Yöneticileri
Boğaziçi Üniversitesi TTO İşbirliği ile uygulanacak olan Gelişmiş Ülkelerde "Smart Beta" stratejisi olarak bilinen yöntem ile ağırlıklandırılacak fon uzun vadede endeksin üzerinde getiri hedeflemektedir.	Mehmet Gerz Suna Tannıverdi Fidan
En Az Alınabilir Pay Adedi : 10 Adet	

Yatırım Stratejisi

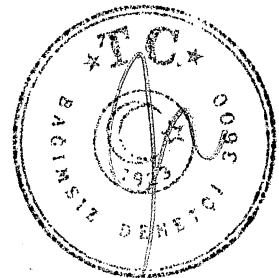
Borsa İstanbul'daki hisse senetlerine kurala dayalı bir endeks algoritmasına göre yatırım yapacaktır. Borsa İstanbul endekslerindeki hisse senetleri, halka açık piyasa değerine göre değil; başka kriterlere göre ağırlıklandırılarak, uzun vadede endeksin üzerinde getiri sağlamayı hedeflemektedir. Gelişmiş ülkelerde "Smart Beta" stratejisi olarak bilinen bu yöntem, Boğaziçi Üniversitesi TTO ile işbirliği halinde uygulanacaktır.

Fonun mevcut durumdaki yatırım stratejisi aşağıdaki gibidir:

Hisse Senedi (APY) %80-%100

Yatırım Riskleri

1) Piyasa Riski: Piyasa riski ile borçlanmayı temsil eden finansal araçların, ortaklık paylarının, diğer menkul kıymetlerin, faiz oranları, ortaklık payı fiyatlarında meydana gelebilecek zarar riski ifade edilmektedir. Söz konusu risklerin detaylarına aşağıda yer verilmektedir: a- Faiz Oranı Riski: Fon portföyüne faize dayalı varlıkların (borçlanma aracı, ters repo vb) dahil edilmesi halinde, söz konusu varlıkların değerinde piyasalarda yaşanabilecek faiz oranları değişimleri nedeniyle oluşan riski ifade eder. b- Kur Riski: Fon portföyüne yabancı para cinsinden varlıkların dahil edilmesi halinde, döviz kurlarında meydana gelebilecek değişiklikler nedeniyle Fon'un maruz kalacağı zarar olasılığını ifade etmektedir. c- Ortaklık Payı Fiyat Riski: Fon portföyüne ortaklık payı dahil edilmesi halinde, Fon portföyünde bulunan ortaklık paylarının fiyatlarında meydana gelebilecek değişiklikler nedeniyle portföyün maruz kalacağı zarar olasılığını ifade etmektedir. 2) Karşı Taraf Riski: Karşı tarafın sözleşmeden kaynaklanan yükümlülüklerini yerine getirmek istememesi ve/veya yerine getirememesi veya takas işlemlerinde ortaya çıkan aksaklıklar sonucunda ödemenin yapılamaması riskini ifade etmektedir. 3) Likidite Riski: Fon portföyünde bulunan finansal varlıkların istenildiği anda piyasa fiyatından nakde dönüştürülebilmesi halinde ortaya çıkan zarar olasılığıdır. 4) Kaldıraç Yaratıcı İşlem Riski: Fon portföyüne türev araç (vadeli işlem ve opsiyon sözleşmeleri), ileri valörlü tahvil/bono 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 kaydedebileceği olasılığı kaldıraç riskini ifade eder. 5) Operasyonel Risk: Operasyonel risk, fonun operasyonel süreçlerindeki aksamalar sonucunda zarar oluşması olasılığını ifade eder. Operasyonel riskin kaynakları arasında kullanılan sistemlerin yetersizliği, başarısız yönetim, personelin hatalı ya da hileli işlemleri gibi kurum içi etkenlerin yanı sıra doğal afetler, rekabet koşulları, politik rejim değişikliği gibi kurum dışı etkenler de olabilir. 6) Yoğunlaşma Riski: Belli bir varlığa ve/veya vadeye yoğun yatırım yapılması sonucu fonun bu varlığın ve vadenin içerdiği risklere maruz kalmasıdır. 7) Korelasyon Riski: Farklı finansal varlıkların piyasa koşulları altında belirli bir zaman dilimi içerisinde aynı anda değer kazanması ya da kaybetmesine paralel olarak, en az iki farklı finansal varlığın birbirleri ile olan pozitif veya negatif yönlü ilişkileri nedeniyle doğabilecek zarar ihtimalini ifade eder. 8) Yasal Risk: Fonun halka arz edildiği/katılma paylarının satıldığı dönemden sonra mevzuatta ve düzenleyici otoritelerin düzenlemelerinde meydana gelebilecek değişikliklerden olumsuz etkilenmesi riskidir. 9) İhraççı Riski: Fon portföyüne alınan varlıkların ihraççısının yükümlülüklerini kısmen veya tamamen zamanında yerine getirememesi nedeniyle doğabilecek zarar ihtimalini ifade eder.



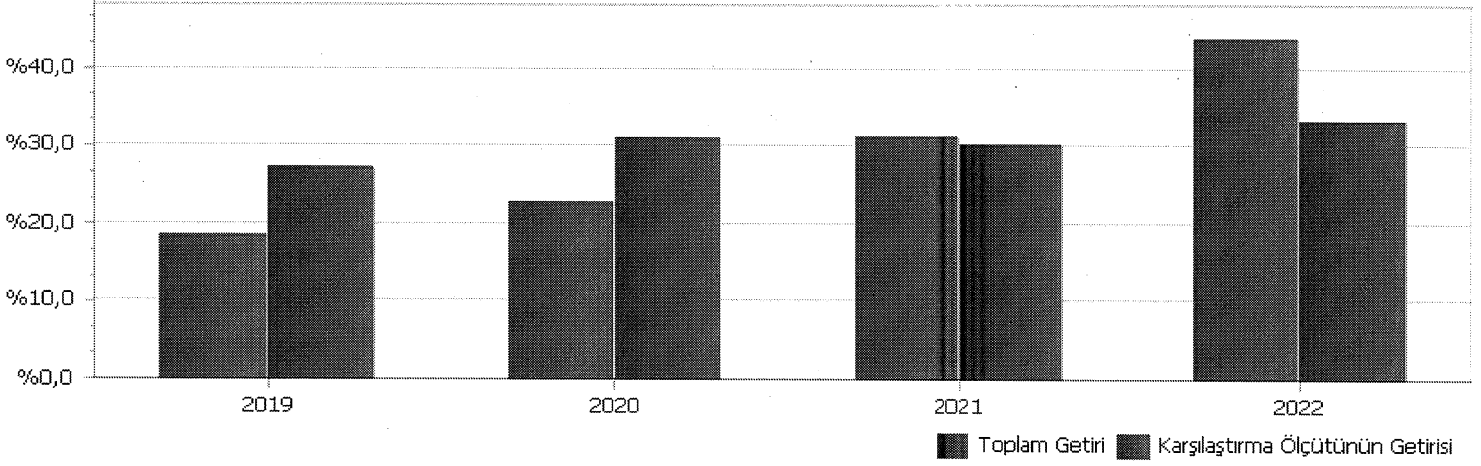
B. PERFORMANS BİLGİSİ

PERFORMANS BİLGİSİ							
YILLAR	Toplam Getiri (%)	Karşılaştırma Ölçütünün Getirisi (%)	Enflasyon Oranı (%) (TÜFE) (*)	Portföyün Zaman İçinde Standart Sapması (%) (**)	Karşılaştırma Ölçütünün Standart Sapması (%) (**)	Bilgi Rasyosu	Sunuma Dahil Dönem Sonu Portföyün Toplam Değeri / Net Aktif Değeri
2019	18,500%	27,046%	6,496%	1,202%	1,1937%	-0,2022	6.417.475,81
2020	22,752%	30,855%	14,599%	1,669%	1,6638%	-0,0892	8.196.446,16
2021	31,278%	30,046%	36,081%	1,544%	1,6320%	0,0042	14.575.239,43
2022 (***)	43,847%	33,309%	42,354%	1,639%	1,7572%	0,0652	31.329.727,16

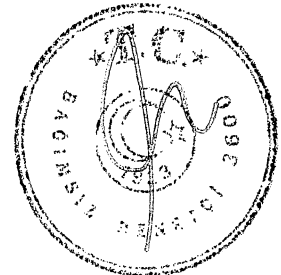
(*) Enflasyon oranı TÜİK tarafından açıklanan 12 aylık TÜFE'nin dönemsel oranıdır.

(**) Portföyün ve karşılaştırma ölçütünün standart sapması dönemindeki günlük getiriler üzerinden hesaplanmıştır.

(***) İlgili veriler sene başından itibaren rapor tarihine kadar olan değerleri vermektedir.

PERFORMANS GRAFİĞİ

GEÇMİŞ GETİRİLER GELECEK DÖNEM PERFORMANSI İÇİN BİR GÖSTERGE SAYILMAZ.



C. DİPNOTLAR

3) Portföy yönetim politikamız, tecrübelerimiz ve proaktif yönetim stratejilerimiz ile varlık dağılımını dinamik ve etkin bir süreçte yöneterek müşterilerimizin varlıklarını korumak ve üzerine katma değer yaratmaktır.

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

3) Fonun 01/01/2022 - 30/06/2022 dönemine ait fon getirisine "B. PERFORMANS BİLGİSİ" bölümünde yer verilmiştir.

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

Karşılaştırma Ölçütünün Getirisi : Fonun karşılaştırma ölçütünün ilgili dönem içerisinde belirtilen varlık dağılımları ile ağırlıklandırarak hesaplanmış olan yüzdesel getirisini ifade etmektedir.

Nispi Getiri : Performans sonu dönemi itibarıyla 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.

1.01.2022 - 30.06.2022 döneminde :	Portföy Değerine Oranı (%)	TL Tutar
Fon Yönetim Ücreti	1,093766%	243.142,02
Denetim Ücreti Giderleri	0,019342%	4.299,63
Saklama Ücreti Giderleri	0,075209%	16.718,74
Aracılık Komisyonu Giderleri	0,082414%	18.320,42
Kurul Kayıt Ücreti	0,009688%	2.153,72
Diğer Faaliyet Giderleri	0,054961%	12.217,80
Toplam Faaliyet Giderleri	296.852,33	
Ortalama Fon Portföy Değeri	22.229.809,41	
Toplam Faaliyet Giderleri / Ortalama Fon Portföy Değeri	1,335380%	

5) Performans sunum döneminde 1 defa strateji değişimi gerçekleşmiştir. İlgili dönemlerdeki yatırım stratejileri aşağıdaki tabloda gösterilmektedir.

Strateji Dönemi	Strateji Bilgisi
13.06.2019-13.06.2019	Gayrimenkul Sertifikaları %0-%20, Kira sertifikası %0-%20, Yatırım Fonu Katılma Belgeleri %0-%20, Hisse %80-%100, Girişim Sermayesi Yatırım Fonu + Gayrimenkul Yatırım Fonu %0-%20, Varlığa Dayalı Menkul Kıymetler %0-%20, Yatırım fonu Katılma Payları-BYF Katılma Payları-Yabancı Yatırım Fonu Katılma Payları %0-%20
9.05.2022-...	Hisse Senedi (APY) %80-%100

Kıstas Dönemi	Kıstas Bilgisi
13.06.2019-...	%100 BIST 100 GETİRİ

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

