

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

PORTFÖYE BAKIŞ
Halka Arz Tarihi : 01/11/2012

YATIRIM VE YÖNETİME İLİŞKİN BİLGİLER

30/06/2020 tarihi itibarıyla	
Fon Toplam Değeri	168,434,107
Birim Pay Değeri (TRL)	0.033629
Yatırımcı Sayısı	30
Tedavül Oranı (%)	33.39%
Portföy Dağılımı	
Paylar	97.98%
- Holding	10.02%
- Sigorta	8.80%
- Bankacılık	8.26%
- İletişim	8.02%
- Cam	7.19%
- Biracılık Ve Meşrubat	6.96%
- Otomotiv	6.00%
- Perakende	5.64%
- Demir, Çelik Temel	5.59%
- Petrol Ve Petrol Ürünleri	5.22%
- Madencilik	4.75%
- Dayanıklı Tüketim	4.26%
- Diğer	4.08%
- İletişim Cihazları	3.68%
- Tekstil, Entegre	3.47%
- Aracı Kurum	3.05%
- Gıda	2.99%
Teminat	2.02%

Fon'un Yatırım Amacı	Portföy Yöneticileri
Fon'un amacı, yatırımcısına orta ve uzun vadede BIST-100 endeksinin üzerinde getiri sağlamaktır.	Mehmet Gerz
En Az Alınabilir Pay Adedi : 100 Adet	Suna Tanrıverdi Fidan
Yatırım Stratejisi	
Fon'un hisse senedi yoğun fon olması nedeniyle Fon toplam değerinin en az %80'i devamlı olarak menkul kıymet yatırım ortaklıkları payları hariç olmak üzere BİST'te işlem gören ihraççı payları, ihraççı paylarına ve ihraççı payı endekslerine dayalı olarak yapılan vadeli işlem sözleşmelerinin nakit teminatları, ihraççı paylarına ve ihraççı payına dayalı opsiyon sözleşmelerinin primleri ile borsada işlem gören ihraççı paylarına ve ihraççı payına dayalı aracı kuruluş varantlarına yatırılır. Hisse senedi seçim kriteri temel analiz odaklı araştırmaya dayalıdır. Orta ve uzun vadede yüksek fiyat artışı sağlayacak şirket hisseleri tercih edilir. Fon'un amacı, yatırımcısına orta ve uzun vadede BIST-100 endeksinin üzerinde getiri sağlamaktır.	
Yatırım Riskleri	
1) Piyasa Riski: Piyasa riski ile borçlanmayı temsil eden finansal araçların, ortaklık paylarının, diğer menkul kıymetlerin, faiz oranları, ortaklık payı fiyatlarında dalgalanmalar nedeniyle 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- 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 aksaklıklarsonucunda 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 Yaratılan İşlem Riski: Fon portföyüne türev araç (vadeli işlem ve opsiyonsözleşmeleri), ileri valörlü tahvil/bono ve diğer herhangi bir yöntemle kaldıraç yaratan benzerişlemlerde bulunulması halinde, başlangıç yatırımı ile başlangıç yatırımının üzerinde pozisyonlanılması sebebi ile fonun başlangıç yatırımından daha yüksek zarar kaydedebilme olasılığı kaldıraçriskini ifade eder. 5) Operasyonel Risk: Operasyonel risk, fonun operasyonel süreçlerindeki aksamalarsonucunda 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 dışi etkenler de olabilir. 6) Yoğunlaşma Riski: Belli bir varlığa ve/veya vadeye yoğun yatırım yapılması sonucufonun 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) Yapılandırılmış Yatırım Aracı Riski: Yapılandırılmış yatırım araçlarının dayanak varlığının piyasa fiyatındaki değişimine bağlı olarak, yapılandırılmış yatırım aracının değerinde meydana gelebilecek zarar riskini ifade etmekte olup, bu araçlar karşı taraf riski, likidite riski,piyasa riski ve kur riskinin tamamını içerebilmektedir. 10) İhraççı Riski: Fon portföyüne alınan varlıkların ihraççısının yükümlülüklerini kısmen veya tamamen zamanında yerine getirememesi nedeniyle doğabilecek zarar ihtimalini ifade eder. 11) Karşı Taraf Riski: Karşı tarafın sözleşmeden kaynaklanan yükümlülüklerini yerine getirmek istememesi ve/veya yerine getirememesi veya takas işlemlerinde ortaya çıkan aksaklıklarsonucunda ödemenin yapılamaması riskini ifade etmektedir.	

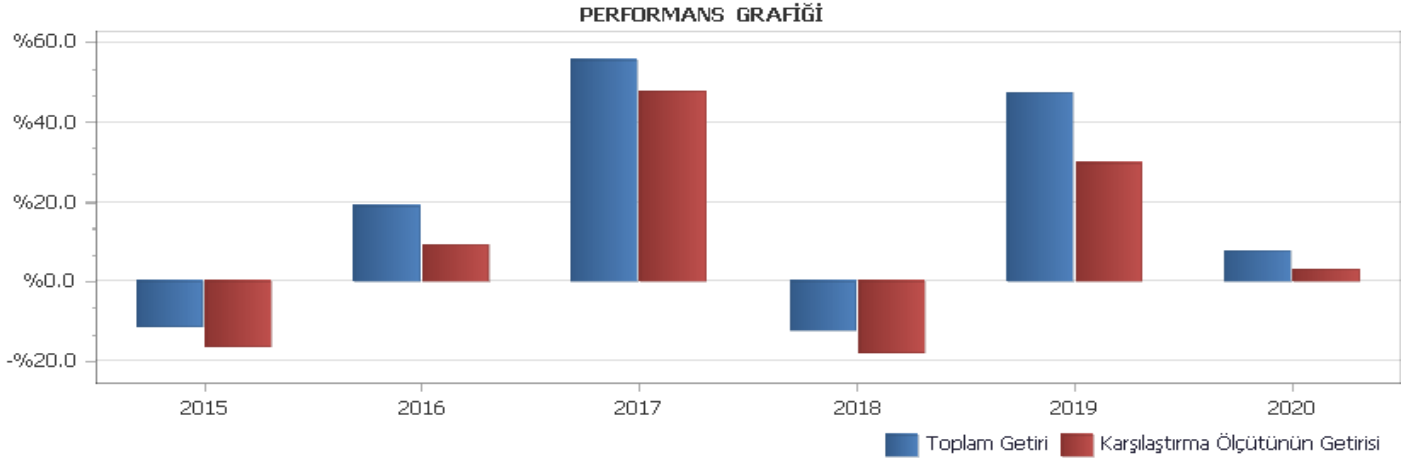
B. PERFORMANS BİLGİSİ

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
2015	-11.607%	-16.325%	8.808%	1.411%	1.3994%	0.0980	29,424,740.82
2016	18.878%	8.939%	8.533%	1.239%	1.2999%	0.1548	34,097,456.78
2017	55.636%	47.600%	11.920%	0.954%	0.9927%	0.0931	28,770,702.81
2018	-12.296%	-18.068%	20.302%	1.235%	1.3822%	0.0693	48,775,033.20
2019	47.432%	29.685%	11.836%	1.244%	1.3004%	0.1469	89,688,581.90
2020 (**)	7.568%	2.793%	5.753%	1.956%	1.8647%	0.0935	168,434,107.22

(*) 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.



GEÇMİŞ GETİRİLER GELECEK DÖNEM PERFORMANSI İÇİN BİR GÖSTERGE SAYILMAZ.

C. DİPNOTLAR

1) 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 01/01/2020 - 30/06/2020 dönemine ait fon getirisine "B. PERFORMANS BİLGİSİ" bölümünde yer verilmiştir.

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

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

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

01/01/2020 - 30/06/2020 döneminde :	Portföy Değerine Oranı (%)	TL Tutar
Fon Yönetim Ücreti	0.957847%	1,258,199.12
Denetim Ücreti Giderleri	0.005809%	7,629.88
Saklama Ücreti Giderleri	0.071350%	93,723.24
Aracılık Komisyonu Giderleri	0.153622%	201,793.49
Kurul Kayıt Ücreti	0.064595%	84,849.53
Diğer Faaliyet Giderleri	0.002082%	2,735.28
Toplam Faaliyet Giderleri	1,648,930.54	
Ortalama Fon Portföy Değeri	131,357,014.39	
Toplam Faaliyet Giderleri / Ortalama Fon Portföy Değeri	1.255305%	

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

Kıstas Dönemi	Kıstas Bilgisi
02/12/2013-31/12/2017	%100 BIST 100
01/01/2018-...	%100 BIST 100 GETİRİ

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