

Yatırımcı Bilgi Formu

Bu form, bu Fon ile ilgili temel bilgileri ve Fon'a yatırım yapmaktan kaynaklanan riskleri içerecek şekilde sermaye piyasası mevzuatı uyarınca hazırlanmıştır. Bu form, bir satış ya da pazarlama dokümanı değildir. Fon hakkındaki temel bilgileri edinmek ve fona ilişkin temel riskleri anlayabilmek için Fon'a yatırım yapmaya karar vermeden önce bu formu okumanız tavsiye edilir.

Deniz Portföy Özel Sektör Borçlanma Araçlarına Yatırım Yapan %100 Anapara Koruma Amaçlı İkinci Fon

ISIN KODU: TRYDNZP00538

Talep Toplama Dönemi: 27/04/2021 – 03/05/2021 Yatırım dönemi: : 04/05/2021 –01/06/2022 (394 gün)

Fon Hakkında

Bu fon, koruma amaçlı fondur ve bu formda belirlenen risk profilindeki yatırımcılara yöneliktir. Fon portföyü Deniz Portföy Yönetimi A.Ş. tarafından yönetilmektedir. Deniz Portföy Yönetimi A.Ş. Denizbank A.Ş. grubuna ait bir şirkettir.

Yatırım Amacı ve Politikası

Fon'un yatırım stratejisi yatırım dönemi sonu olan 01/06/2022 tarihi itibarıyla,

i) Yatırımcının anaparasının tamamının korunmasını,
ii) Altının Amerikan Doları cinsi getirisini takip eden SPDR – Standard & Poor's Depositary Receipt Altın Borsa Yatırım Fonu'na (Altın BYF) dayalı ve aşağıda detayları verilen belirli kısıtları içeren borsa dışı opsiyon sözleşmesinden kaynaklanan bir getiri oluşması halinde bu getiriyi getiriye katılım oranı ölçüsünde yatırımcılara sağlamayı hedeflemektedir. Asgari olarak, başlangıç yatırımınızın %100'ünün, yatırım döneminin sonu olan (01/06/2022) tarihinde geri ödenmesi amaçlanmaktadır. Yatırım dönemi öncesinde fondan çıkılması halinde, korumadan yararlanılamaz. Sadece fonun yatırım dönemi sonuna kadar fonda kalan yatırımcılar korumadan yararlanabilir. Fonun yatırım döneminin bitiminin 2 (iki) iş günü öncesi olacak olan opsiyon sözleşmesinin vade tarihinde, Altın BYF Getirisi negatif yani zarar olarak hesaplanırsa dahi getiri %0 olarak kabul edilecektir. Diğer bir deyişle yatırımcılar opsiyon sözleşmesinin vade tarihinde Altın BYF fiyatında yaşanacak bir düşüşten olumsuz etkilenmeyecektir. Bu durum, yatırımcılar için bir avantajdır. Bununla birlikte, Altın BYF Fiyat Getirisi için bir Getiri Tavan Seviyesi bulunmaktadır. Getiri tavan seviyesinin %20 – %30 arasında gerçekleşmesi beklenmektedir. Fon; Altın BYF Amerikan Doları (USD) cinsinden fiyatındaki getirisine (en fazla %30 olması beklenen bariyer seviyesine kadar) yatırım yapan opsiyon sözleşmesinden katılım oranı ölçüsünde faydalanacaktır. Altın BYF hesaplanan getirisinin bariyer seviyesi olması beklenen %30'den yüksek olması durumunda, opsiyon getirisi bariyer seviyesi olan %30 olarak kabul edilecek ve Fon bu getiriye katılım oranında iştirak edecektir. Bu durum, yatırımcılar için bir dezavantajdır. Getiriye katılım oranının %100 ila %150 arasında gerçekleşmesi beklenmektedir.

Altın BYF Amerikan Doları cinsinden fiyatında meydana gelen yüzdelik artış, getiriye katılım oranı dikkate alınarak Türk Lirası getiri olarak yansıtılacaktır. Bu nedenle yatırımcı herhangi bir kur riski taşımamaktadır.

- Anapara koruması amacına yönelik olarak, Fon portföyünün yaklaşık %83-%89'u ile Denizbank A.Ş., tarafından ihraç edilecek özel sektör borçlanma aracına yatırım yapılacaktır.

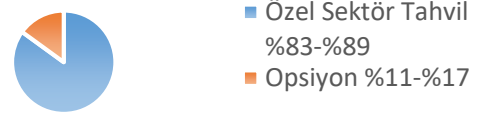
Fonun eşik değeri = **[Katılım Oranı *Maksimum**

{0;Minimum(Altının BYF Getirisi; Bariyer Seviyesi)}}'' dir.

- Fon portföyündeki yatırım amacıyla kaldıraç yaratan işlemler dahil edilmesiyle maruz kalınan açık pozisyon tutarı, fon toplam değerini aşamaz.
- Yatırım yapılacak varlıkların belirlenmesinde Deniz Portföy Yönetimi A.Ş. yetkilidir.

Portföy Dağılımı

- 22/04//2021 tarihli Portföy dağılımı aşağıdaki gibidir.



Alım Satım ve Vergileme Esasları

Fon katılma payı alım satımının yapılacağı para birimi TL'dir. Katılma payı satın almak isteyen yatırımcılar tarafından, talep toplama dönemi içinde 09:00 ile 16:00 saatleri arasında, adres ve iletişim bilgileri izahnamenin 7.7. nolu bölümünde yer alan kurumlara başvurarak "Talep Formu" doldurulur. Yatırımcılardan fon izahnamesi ve yatırımcı bilgi formunun okunup anlaşıldığı ve risklerin algılandığı bilgisini içeren pay alım talimatı alınacaktır. Yatırımcıların fon payı alımında asgari pay alım limiti 1.000 pay (1.000 TL) olup bir payın satış fiyatı 1 TL'dir. Pay alım talimatı 1.000 pay (1.000 TL) ve katları şeklinde artırılabilir. Talepler tutar üzerinden alınacaktır. Alım talimatının karşılığında tahsil edilen tutar talep dönemi süresince yatırımcı hesabında yatırımcı adına Deniz Portföy Para Piyasası Fonu ile nemalandırılır. Katılma payı alımına nema tutarı dahil edilmez. Nema tutarı, talep toplama dönemini takip eden ilk iş günü yatırımcının vadesiz mevduat hesabına geçecektir. Talep toplama döneminde iletilen alım talimatları, talep toplama döneminin son günü saat 13:30'a kadar yatırımcı tarafından iptal edilebilir. Fon pay fiyatı her ayın 2'sinde ve 16'sında olmak üzere ayda 2 kez hesaplanır ve ilan edilir. Fiyat hesaplama gününün, opsiyonun karşı tarafının bulunduğu ülke piyasası ve/veya BIST Borçlanma Araçları Piyasası ve/veya dayanak varlığının işlem gördüğü organize borsa/fiyat açıklayıcı kurum için tatil gününe denk gelmesi halinde bu piyasaların açık olduğu takip eden ilk iş günü yapılacak hesaplama dikkate alınır. Fon pay fiyatının hesaplanacağı gün saat 10:00'ya kadar girilen emirler, açıklanacak fiyat üzerinden yatırımcı hesaplarına pay fiyatının hesaplandığı günden (T) 2 işgünü (T+2) sonra aktarılır. Pay fiyatının hesaplandığı gün saat 10:00'dan sonra girilen satım emirleri ise bir sonraki fiyat açıklama tarihine kadar bekletilir. Pay satım talimatları 1.000 pay ve katları olarak verilir.

Yatırım Dönemi Sonunda Satım Bedellerinin Ödenme Esasları: Fon katılma payı bedellerinin TL tutarları fonun yatırım dönemi sonunu takip eden ilk iş günü nakit olarak yatırımcıların dağıtıcı kuruluşlar nezdindeki hesaplarına aktarılır.

- Gerçek kişilerin fon katılma payı alım satım kazancı %10; tüzel kişilerin fon katılma payı alım satım kazancı %0 oranında stopaja tabidir. Bu konudaki istisnalar ve diğer detaylar için ise formun “**Önemli Bilgiler**” bölümü incelenmelidir.
- Fon katılma payı alım satımına aracılık edecek kuruluşlar Denizbank A.Ş. ve Deniz Yatırım Menkul Kıymetler A.Ş.’dir.
- Fon katılma payları, Türkiye Elektronik Fon Dağıtım Platformu’nda işlem görmemektedir.

Risk ve Getiri Profili

Düşük Risk
Potansiyel Düşük Getiri

Yüksek risk
Potansiyel Yüksek Getiri

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

- Belirtilen risk değeri fonun yatırım yaptığı türev aracın dayanak varlığına ilişkin geçmiş veriler kullanılarak yapılan simülasyona göre belirlenmiştir ve fonun gelecekteki risk profiline ilişkin güvenilir bir gösterge olmayabilir.
- Risk değeri zaman içinde değişebilir.
- En düşük risk değeri dahi, bu Fon’a yapılan yatırımın hiçbir risk taşımadığı anlamına gelmez.
- Fon’un belirtilen risk değerine sahip olma gerekçeleri: Fon portföyünde Altın BYF fiyatına dayalı opsiyon sözleşmesine yatırım yapılacak olması ve altın fiyatındaki volatilité nedeniyle fon ilgili risk seviyesindedir.

Fon’un Maruz Kalacağı Temel Riskler

Faiz oranı riski, kredi riski, likidite riski, kıymetli maden ve emtia fiyat riski, karşı taraf riski, operasyonel risk, kaldıraç yaratan işlem riski ve borsa yatırım fonuna yatırım yapıldığında oluşabilecek riskler’dir.

Ücret, Gider ve Komisyon Bilgileri

Aşağıdaki tabloda yer alan ücret, gider ve komisyonlar Fon’un getirisini doğrudan etkiler.

Fon’dan karşılanan giderler	%
Yıllık azami fon toplam gider oranı	%2,19
Yönetim ücreti-Yaklaşık (yıllık)	Asgari
Kurucu (%50) ile Fon Dağıtım Kuruluşu* (%50) arasında paylaştırılacaktır.	%0,9
(Dağıtıcı kuruluşa ödenen tutar, dağıtıcı	azami
	%2,05

kuruluş aracılığıyla satılan Fon tutarı dikkate alınarak hesaplanır.)	
Saklama ücreti (yaklaşık)	%0,08
Diğer giderler (Tahmini)	%0,05

Fon’un Geçmiş Performansı

- Fon’un geçmiş performansı, gelecek dönem performansı için bir gösterge olamaz.
- Fon’un kuruluş tarihi 19/03/2021’dir.
- Fon performansının hesaplamasında birim pay değeri esas alınmıştır.
- Fon paylarının satışına 04/05/2021 tarihinde başlanmıştır. Yatırım dönemi sonu olan 01/06/2022 tarihi itibarıyla opsiyon sözleşmesi şartlarına göre bir getiri oluşur ise, opsiyon sözleşmesi şartları ve aşağıda yer verilen kısıtlar dahilinde getiri sağlamak hedeflenmektedir. Getiriye ilişkin kısıtlar aşağıda açıklanmaktadır.
- 1) Örnek senaryolarda hesaplanan getiriler ve vade sonu değeri vergi öncesi rakamları yansıtmaktadır.
- 2) Varsayım olarak iştirak oranı, %120 olarak belirlenmiştir. İştirak oranının daha düşük gerçekleşmesi sonucunda, fon getirisi de örnek senaryolara göre daha düşük olabilecektir.
- 3) Aşağıda gösterilen örnek senaryolar geleceğe yönelik tahmin niteliğinde değildir ve senaryoların gerçekleşme olasılıkları eşit değildir.
- 4) Yatırım dönemi sona ermeden fondan çıkılması halinde fon getirisi, opsiyon getirisine esas olan getiri formülü ile değil, çıkış tarihindeki piyasa koşulları dikkate alınarak hesaplanacaktır.

	1. Durum Yüksek Düzeyde Getiri	2. Durum Orta Düzeyde Getiri	3. Durum Negatif Getiri
Başlangıç Fiyatı	1750	1750	1750
Son fiyat	2450	1925	1610
Altın BYF Getirisi	40.00%	10.00%	-8.00%
Bariyer Seviyesi	30.00%	30.00%	30.00%
Opsiyon Getirisi	30.00%	10.00%	0.00%
İştirak Oranı	120.00%	120.00%	120.00%
Opsiyon Getirisi* İştirak Oranı	36.00%	12.00%	0.00%
Anapara Korumasından Kaynaklanan Getiri	0.00%	0.00%	0.00%
FON GETİRİSİ	36.00%	12.00%	0.00%

Önemli Bilgiler

Fon, Deniz Portföy Yönetimi A.Ş.’nin kurucusu olduğu Deniz Portföy Yönetimi A.Ş. Koruma Amaçlı Şemsiye Fonu’na bağlıdır. Portföy saklayıcısı Denizbank A.Ş.’dir.

Fon hakkında daha fazla bilgiye, izahnameye, içtüzüğe, performans sunum raporuna, yıllık rapor ile finansal tablolara <http://www.kap.org.tr/> ve www.denizportfoy.com adresinden ulaşılabilir.

Fon izahnamesi www.kap.org.tr/’da yayımlanmıştır. Bu husus 19/03/2021 tarihinde ticaret siciline tescil ettirilmiştir. Fon katılma payı fiyatı www.denizportfoy.com da ilan edilir.

Fon, T.C. vergi düzenlemelerine tâbidir. Fonun tabi olduğu vergi düzenlemeleri ile ilgili Bakanlar Kurulu’nun 2006/10371 sayılı kararına <http://www.resmigazete.gov.tr/eskiler/2006/07/20060723-7.htm> adresinden erişilebilmektedir. Deniz PYS’nin, bu formla ilgili sorumluluğu, formdaki yanıltıcı, yanlış ve izahname ile tutarlı olmayan bilgiler ile sınırlıdır.

Şemsiye Fon’a bağlı her bir fonun tüm varlık ve yükümlülükleri birbirinden ayrıdır.

Fon ve Deniz Portföy Yönetimi A.Ş. Türkiye’de yetkilendirilmiş olup, Sermaye Piyasası Kurulu’nun gözetimine ve denetimine tâbidir. Bu form, 04/05/2021 tarihi itibarıyla günceldir.