

ATA PORTFÖY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU'NA AİT PERFORMANS SUNUM RAPORU**A. TANITICI BİLGİLER**

PORTFÖYE BAKIŞ
Halka Arz Tarihi : 9.01.2012

YATIRIM VE YÖNETİME İLİŞKİN BİLGİLER

30.06.2021 tarihi itibarıyla	
Fon Toplam Değeri	1,494,656
Birim Pay Değeri (TRL)	2.567149
Yatırımcı Sayısı	20
Tedavül Oranı (%)	0.03%
Portföy Dağılımı	
Borçlanma Araçları	79.57%
- Devlet Tahvili / Hazine Bonosu	66.41%
- Finansman Bonosu	13.17%
Teminat	20.43%
Toplam	100.00%

Fon'un Yatırım Amacı	Portföy Yöneticileri
Gün içerisinde nakde dönüştürülebilir özelliğine sahip fonun nihai amacı, dalgalanması düşük düzenli getiri elde etmektir.	Mehmet Gerz
En Az Alınabilir Pay Adedi : 100 Adet	Suna Tanrıverdi Fidan
Yatırım Stratejisi	
Fon Toplam değerinin en az %80'i devamlı olarak kamu ve/veya özel sektör borçlanma araçlarından oluşmaktadır. Fon aylık ağırlıklı ortalama vadesi en az 25, en fazla 90 gün olan kısa vadeli tahvil bono fonu niteliğindedir. Yoğunlaşmayı önlemek için tek bir varlığa yatırım limiti, devlet tahvilinde max. %35 uygulanır. Özel sektör tahvillerinde ise aynı grup firmalarını da kapsayacak şekilde ihraççı başına %10 limiti uygulanır. Gün içerisinde nakde dönüştürülebilir özelliğine sahip fonun amacı, dalgalanması düşük düzenli getiri elde etmektir. Fon portföyüne vadeye kalan gün sayısı hesaplanamayan varlıklar dahil edilemez.	
Yatırım Riskleri	
1) Piyasa Riski: Piyasa riski ile borçlanmayı temsil eden finansal araçların, faiz oranlarında, 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. 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 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. 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 sonucunda fonun bu varlığın ve vadenin içerdiği risklere maruz kalmasıdır. 7) Korelasyon Riski: Farklı finansal varlıkların piyasa koşulları altında belirli bir zamandilimi 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.	

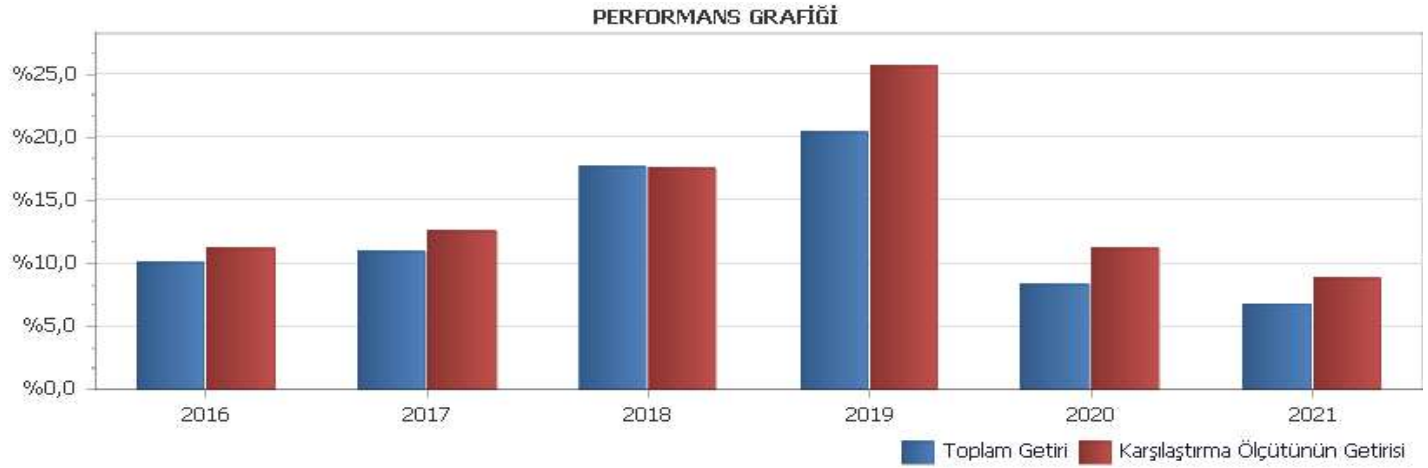
B. PERFORMANS BİLGİSİ

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
2016	10.028%	11.193%	8.533%	0.024%	0.0349%	-0.1070	13,131,688.74
2017	10.961%	12.381%	11.920%	0.028%	0.0358%	-0.1099	12,904,709.10
2018	17.646%	17.508%	20.302%	0.047%	0.0858%	0.0049	8,443,846.39
2019	20.387%	25.669%	11.836%	0.064%	0.0872%	-0.2123	6,127,865.89
2020	8.281%	11.128%	14.599%	0.458%	0.5757%	-0.0202	2,135,180.75
2021 (***)	6.750%	8.838%	8.453%	0.048%	0.0664%	-0.2903	1,494,655.92

(*) 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 1.01.2021 - 30.06.2021 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 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.

1.01.2021 - 30.06.2021 döneminde :	Portföy Değerine Oranı (%)	TL Tutar
Fon Yönetim Ücreti	0.608293%	10,520.59
Denetim Ücreti Giderleri	0.133128%	2,302.48
Saklama Ücreti Giderleri	0.207177%	3,583.18
Aracılık Komisyonu Giderleri	0.000000%	0.00
Kurul Kayıt Ücreti	0.010649%	184.18
Diğer Faaliyet Giderleri	0.112785%	1,950.65
Toplam Faaliyet Giderleri	18,541.08	
Ortalama Fon Portföy Değeri	1,729,525.82	
Toplam Faaliyet Giderleri / Ortalama Fon Portföy Değeri	1.072033%	

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

Kıstas Dönemi	Kıstas Bilgisi
14.12.2015-...	%10 BIST-KYD Repo (Brüt) + %45 BIST-KYD DİBS Kısa + %45 BIST-KYD ÖSBA Değişken

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