

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

30.06.2021 tarihi itibarıyla	
Fon Toplam Değeri	13,342,209
Birim Pay Değeri (TRL)	1.424759
Yatırımcı Sayısı	113
Tedavül Oranı (%)	0.01%

Portföy Dağılımı	
Ortaklık Payları	95.03%
- Tekstil, Entegre	11.22%
- Gıda	10.85%
- Gayrimenkul Yatırım Ort.	9.72%
- Petrol Ve Petrol Ürünleri	8.80%
- Sağlık	8.03%
- İnşaat, Taahhüt	7.78%
- Elektrik	7.42%
- Cam	4.78%
- Teknoloji	4.71%
- Bankacılık	4.58%
- Demir, Çelik Döküm	3.92%
- Madencilik	3.61%
- İletişim	2.52%
- Çimento	2.29%
- Medya	2.04%
- Holding	1.90%
- Perakende	0.88%
Teminat	4.97%
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
En Az Alınabilir Pay Adedi : 10 Adet	Suna Tanrıverdi Fidan
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:	
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	
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 Yaratan 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 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 sonucu fonun bu varlığı 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. 10) 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.	

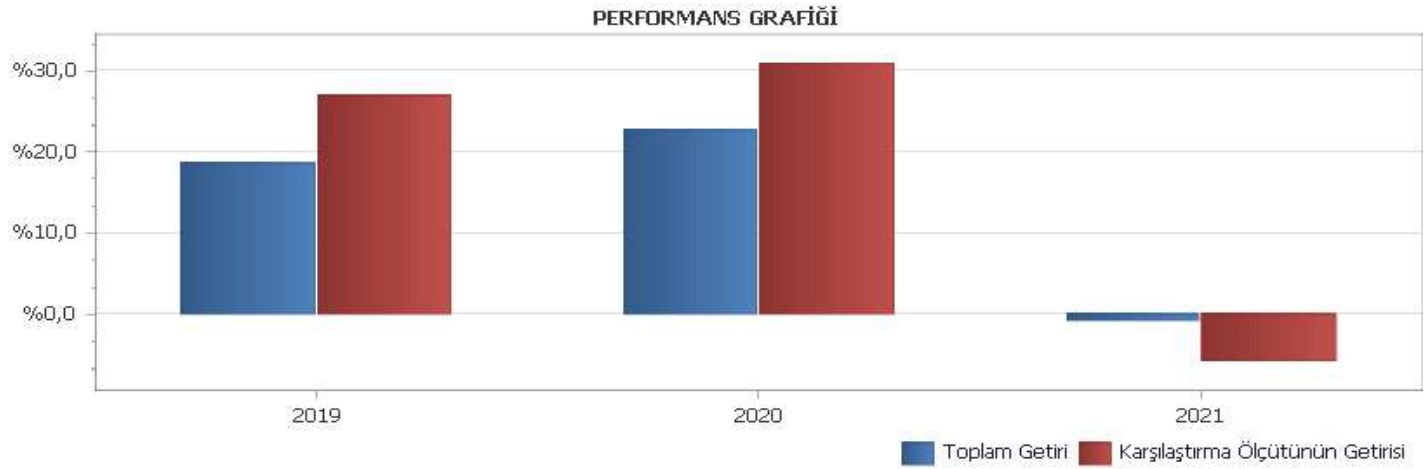
B. PERFORMANS BİLGİSİ

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 (**)	-0.902%	-5.721%	8.453%	1.530%	1.5138%	0.0756	13,342,208.93

(*) 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	1.087167%	137,160.52
Denetim Ücreti Giderleri	0.019932%	2,514.64
Saklama Ücreti Giderleri	0.098278%	12,399.11
Aracılık Komisyonu Giderleri	0.248629%	31,367.87
Kurul Kayıt Ücreti	0.011365%	1,433.89
Diğer Faaliyet Giderleri	0.082669%	10,429.83
Toplam Faaliyet Giderleri	195,305.86	
Ortalama Fon Portföy Değeri	12,616,329.77	
Toplam Faaliyet Giderleri / Ortalama Fon Portföy Değeri	1.548040%	

5) Performans sunum dönemi içerisinde strateji sabit kalmıştır.

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

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