

NEO PORTFÖY BİRİNCİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

**9 MART- 30 HAZİRAN 2021 DÖNEMİNE AİT
PERFORMANS SUNUM RAPORU VE
YATIRIM PERFORMANSI KONUSUNDA KAMUYA
AÇIKLANAN BİLGİLERE İLİŞKİN RAPOR**

**NEO PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş. TARAFINDAN KURULAN VE YÖNETİLEN
NEO PORTFÖY BİRİNCİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU**

**9 MART- 30 HAZİRAN 2021 DÖNEMİNE AİT
PERFORMANS SUNUM RAPORU**

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

A. TANITICI BİLGİLER

PORTFÖY BİLGİLERİ		YATIRIM VE YÖNETİME İLİŞKİN BİLGİLER
30 Haziran 2021 itibariyle		Portföy Yöneticileri
		Dr. Mustafa Doğan Dilaver Ergin
		En Az Alınabilir Pay Adedi: 1 Adet
		Yatırım Amacı
		Fonun yatırım amacı, fon toplam değerinin devamlı olarak en az %80'i ile portföyün aylık ağırlıklı ortalama vadesi 730 günü aşmayacak şekilde kamu ve özel sektör borçlanma araçlarına yatırım yaparak reel getiri sağlamaktır.
Fon Toplam Değeri	111.458.611,14	Yatırım Stratejisi
Birim Pay Değeri	1,066140	Fon'un yatırım stratejisi; fon toplam değerinin devamlı olarak en az %80'i ile, portföyün aylık ağırlıklı ortalama vadesi 730 günü aşmayacak şekilde kamu ve özel sektör borçlanma araçlarına yatırım yapmaktır. Fon portföyünde ortaklık paylarına, varant ve sertifikalara yer verilmeyecek olup, ağırlıklı olarak sabit/dönemsel getirili yatırım araçlarına yatırım yapılacaktır. Yabancı para ve sermaye piyasası araçları ile vadeye kalan gün sayısı hesaplanamayan varlıklar fon toplam değerinin en fazla %20'si oranında fon portföyüne dahil edilebilir.
Yatırımcı Sayısı	242	
Tedavül Oranı %	10,45	
Portföy Dağılımı %		
Özel Sektör Borçlanma Araçları	89,40	
Ters Repo	8,07	Yatırım Riskleri
Mevduat	2,53	
		Yatırımcılar Fon'a yatırım yapmadan önce Fon ile ilgili temel yatırım risklerini değerlendirmelidir. Yatırımcılar, Fon'un maruz kalabileceği temel risklerden kaynaklanabilecek değişimler sonucunda Fon birim pay değerindeki olası düşüslere bağlı olarak yatırımlarının değerinin başlangıç değerinin altına düşebileceğini dikkate almalıdırlar. Fon'un maruz kalacağı temel risklere fon izahnamesinin III. bölümünde yer verilmiştir. Bu riskler; piyasa riski, karşı taraf riski, likidite riski, kaldıraç yaratan işlem riski, operasyonel risk, yoğunlaşma riski, korelasyon riski, yasal risk, ihraççı riski, yapılandırılmış yatırım araçları riski, kıymetli maden fiyat riskidir. Fon'un yatırım stratejisi ile yatırım yapılan varlıkların yapısına ve risk düzeyine uygun bir risk yönetim sistemi oluşturulmuştur.
Payların Sektörel Dağılımı %		
Bulunmamaktadır.		

NEO PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş. TARAFINDAN KURULAN VE YÖNETİLEN NEO PORTFÖY BİRİNCİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

9 MART- 30 HAZİRAN 2021 DÖNEMİNE AİT PERFORMANS SUNUM RAPORU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

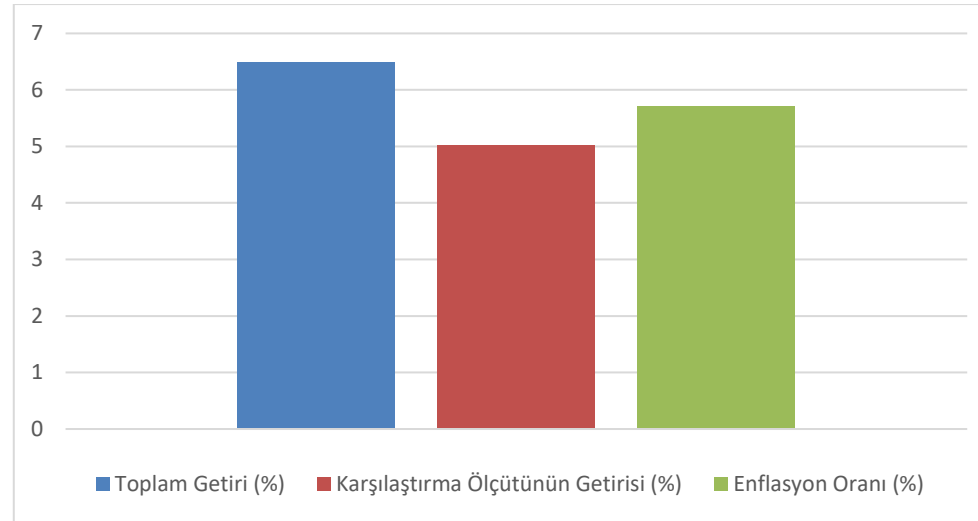
B. PERFORMANS BİLGİSİ

Yıllar	Toplam Getiri (%)	Karşılaştırma Ölçütünün Getirisi/Eşik Değer (%)	Enflasyon Oranı (%)(**)	Portföyün Zaman İçinde Standart Sapması (%)(*)	Karşılaştırma Ölçütünün Standart Sapması (%)(*)	Bilgi Rasyosu	Sunuma Dahil Dönem Sonu Portföyün Net Aktif Değeri
9 Mart-30 Haziran 2021 İLK YIL	6,48	5,02	5,70	0,07	0,10	0,18	111.458.611,14

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

(**) Enflasyon oranı: Enflasyon oranı: Mart-Haziran dönemi için gerçekleşen TÜFE baz alınmıştır

GEÇMİŞ GETİRİLER GELECEK DÖNEM PERFORMANSI İÇİN BİR GÖSTERGE SAYILMAZ.



NEO PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş. TARAFINDAN KURULAN VE YÖNETİLEN NEO PORTFÖY BİRİNCİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

9 MART- 30 HAZİRAN 2021 DÖNEMİNE AİT PERFORMANS SUNUM RAPORU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

C. DİPNOTLAR

1. Fon, Neo Portföy Yönetimi A.Ş. ("Şirket") tarafından yönetilmektedir. Şirketin kuruluş tarihi 28 Nisan 2017'dir. Şirketin ortaklık yapısı; %69,89 Mustafa Doğan, %10 Tanju Günel, %7,5 Bekir Yener Yıldırım, %2,5 Dilaver Ergin, %2,5 Ekin Özoran ve %2,5 Halil Alper Aköz'den oluşmaktadır. Şirketin ana faaliyet konusu, SPKn ve ilgili mevzuat hükümleri çerçevesinde yatırım fonlarının kurulması ve yönetimidir. Ayrıca, yatırım ortaklıklarının, 28.3.2001 tarihli ve 4632 sayılı Bireysel Emeklilik Tasarruf ve Yatırım Sistemi Kanunu kapsamında kurulan emeklilik yatırım fonlarının ve bunların muadili yurt dışında kurulmuş yabancı kolektif yatırım kuruluşlarının portföylerinin yönetimi de ana faaliyet konusu kapsamındadır.

Şirket tarafından 30 Haziran 2021 tarihi itibarıyla, 5 adet kurucusu olduğu Yatırım Fonu, 5 adet kurucusu olduğu Gayrimenkul Yatırım Fonu, 7 adet kurucusu olduğu Girişim Sermayesi Yatırım Fonu yönetilmektedir.

Şirketin 15.000.000 TL kayıtlı sermaye tavanı içerisinde çıkarılmış sermayesinin tamamı nakden karşılanmak suretiyle 4.000.000 TL'den 9.000.000 TL'ye artırılmıştır ve 14.06.2021 tarihinde ticaret siciline tescil edilmiştir.

2. Fon portföyünün yatırım amacı, yatırımcı riskleri ve stratejileri "Tanıtıcı Bilgiler" bölümünde belirtilmiştir. Fon portföyünde yer alabilecek varlık ve işlemler için belirlenmiş asgari ve azami sınırlamalar aşağıdaki tabloda gösterilmiştir.

VARLIK ve İŞLEM TÜRÜ	Asgari %	Azami %
Kamu ve Özel Sektör Borçlanma Araçları	80	100
Mevduat/Katılma Hesapları (TL, Döviz) *	0	10
Kamu Dış Borçlanma Araçları (Eurobond)	0	20
Yabancı Para ve Sermaye Piyasası Araçları (Kamu ve/veya özel sektör)	0	20
Ters Repo İşlemleri	0	20
Yerli veya Yabancı Kira Sertifikaları (Kamu ve/veya Özel Sektör)	0	20
Varlığa Dayalı ve/veya Varlık Teminatlı Menkul Kıymetler	0	20
Gelir Ortaklığı Senetleri ve/veya Gelire Endeksli Senetler	0	20
Altın ve Kıymetli Madenler ile bu Madenlere Dayalı Sermaye Piyasası Araçları	0	20
Yatırım Fonu Katılma Payları, Borsa Yatırım Fonu Katılma Payları, Gayrimenkul Yatırım Fonu Katılma Payları, Girişim Sermayesi Yatırım Fonu Katılma Payları	0	20
Yapılandırılmış Yatırım Araçları	0	10
İpoteğe Dayalı ve/veya İpotek Teminatlı Menkul Kıymetler	0	20
Takasbank Para Piyasası İşlemleri	0	20
Borsa Dışı Ters Repo İşlemleri	0	10

NEO PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş. TARAFINDAN KURULAN VE YÖNETİLEN NEO PORTFÖY BİRİNCİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

9 MART- 30 HAZİRAN 2021 DÖNEMİNE AİT PERFORMANS SUNUM RAPORU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

* Fon toplam değerinin en fazla %10'u 12 aydan uzun olmamak kaydıyla, mevduat/katılma hesaplarında değerlendirilebilir.

- Fonun karşılaştırma ölçütü 9 Mart 2021 tarihinde, %20 BIST-KYD DİBS Orta Endeksi + %30 BIST-KYD ÖSBA Sabit Endeksi + %30 BIST-KYD ÖSBA Değişken Endeksi + %10 BIST-KYD Repo (Brüt) Endeksi + %10 BIST-KYD 1 Aylık Mevduat TL Endeksi olarak belirlenmiştir.
- Fonun 9.03.2021-30.06.2021 dönemindeki net getirisi %6,48 ve karşılaştırma ölçütünün getirisi %5,02'dir. Aynı dönemdeki fonun nispi getirisi %1,46 olarak gerçekleşmiştir.

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 ağırlıklandırılarak hesaplanmış olan yüzdesel getirisini ifade etmektedir.

Nispi getiri; performans dönemi sonu itibarıyla hesaplanan portföy getiri oranının karşılaştırma ölçütünün/eşik değerin getiri oranı ile karşılaştırılması sonucu elde edilecek pozitif ya da negatif yüzdesel değerdir.

- Performans sunum dönemine ait brüt getiri hesabı aşağıda sunulmaktadır:

Net Getiri	%6,48
Gerçekleşen Fon Toplam Giderleri Oranı (*)	%0,56
Azami Toplam Gider Oranı(Dönemsel)	%1,825
Kurucu Tarafından Karşılanan Giderlerin Oranı	%0,00
Net Gider Oranı	%0,56
Brüt Getiri	%7,04

(*) Kurucu tarafından karşılananlar da dahil tüm fon giderlerinin ortalama net varlık değerine oranını ifade etmektedir

- Yönetim ücretleri, vergi, saklama ücretleri ve diğer faaliyet giderlerinin günlük brüt portföy değerine oranının ağırlıklı ortalaması aşağıdaki gibidir:

9 Mart - 30 Haziran 2021 döneminde:	Tutar (TL)	Dönem İçi Ortalama Fon Toplam Değerine Oranı(%)
Tescil ve İlan Giderleri	4.175,78	0,01
Bağımsız Denetim Ücreti	4.351,63	0,01
Saklama Ücretleri	12.553,83	0,03
Fon Yönetim Ücreti	213.281,36	0,49
Tahvil Bono Komisyonu	1.890,90	0,00
Gecelik Ters Repo Komisyonu	3.748,50	0,01
Borsa Para Piyasası Komisyonu	1.167,74	0,00
Vergi ve Diğer Giderler	292,20	0,00
Diğer Giderler	6.181,53	0,01
TOPLAM GİDERLER	247.643,47	0,56
DÖNEM İÇİ ORTALAMA FON TOPLAM DEĞERİ	43.740.766,10	

**NEO PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş. TARAFINDAN KURULAN VE YÖNETİLEN
NEO PORTFÖY BİRİNCİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU**

**9 MART- 30 HAZİRAN 2021 DÖNEMİNE AİT
PERFORMANS SUNUM RAPORU**

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

D. İLAVE BİLGİLER VE AÇIKLAMALAR

1. 9 Mart - 30 Haziran 2021 dönemi için hesaplanan bilgi rasyosu 0,18 olarak gerçekleşmiştir. Riske göre düzeltilmiş getirinin hesaplanmasında “Bilgi Rasyosu” (Information Ratio) kullanılmıştır. Bilgi rasyosu, fonun günlük getiri oranı ile karşılaştırma ölçütünün günlük getiri oranı/eşik değer farklarının performans dönemi boyunca ortalamasının, fonun günlük getiri oranı ile karşılaştırma ölçütünün günlük getiri oranı/eşik değer farklarının performans dönemi boyunca standart sapmasına oranı olarak hesaplanmaktadır.
2. Performans sunum döneminde yatırım stratejisi değiştirilmemiştir.
3. Neo Portföy Yönetimi A.Ş. Borçlanma Araçları Şemsiye Fon’a bağlı olarak kurulmuştur.
4. Fon’a portföy saklayıcılığı hizmeti Denizbank Anonim Şirketi tarafından verilmektedir.
5. Yatırım fonlarının portföy işletmeciliğinden doğan kazançlar kurumlar vergisi ve stopajdan muaftır.

.....