

Fiba Port. Şekerbank Para Piyasası Fonu Performans Sunuş Raporu

A. TANITICI BİLGİLER

PORTFÖYE BAKIŞ		Halka Arz Tarihi: 12.12.1996		YATIRIM VE YÖNETİME İLİŞKİN BİLGİLER	
İlk Tarih:	01.01.2021				
Bitiş Tarihi:	30.06.2021				
Fon Kodu	SLF				
Fon Toplam Değeri		146,548,848.03		Fonun Yatırım Amacı	Portföy Yöneticileri Hakan Basri AVCI Ruşen Fıdda SÖZMEN Ateş KAYMAK Diler KAYRA Kamuran KARA
Birim Pay Değeri		2.086374			
Yatırımcı Sayısı		6126			
Tedavül Oranı %		0.07			
Portföy Dağılımı		Yatırım Stratejisi			
BPP		10.49%		Fon portföyüne, Sermaye Piyasası Kurulu'nun düzenlemeleri, Şemsiye Fon içtüzüğü ve fon izahnamesine uygun olan varlıklar seçilir ve Fon, söz konusu düzenlemeler ile fon bilgilendirme dokümanlarında belirtilen esaslara uygun olarak yönetilir. Fon portföyü yönetiminde yatırım yapılacak sermaye piyasası araçları seçiminde nakde dönüşümü kolay ve riski az olanlar tercih edilir. Fon portföyünde riskin dağıtılmasına uygun hareket edilmesi şartıyla, ağırlıklı olarak borçlanma araçları ile ters repoya yer verilir. Piyasada oluşabilecek şartlar nedeniyle fon portföyü zaman zaman ağırlıklı olarak repo ya da kamu ve/veya özel sektör tahvillerinden oluşabilir. Fon portföyünün tamamı devamlı olarak, vadesine en fazla 184 gün kalmış likiditesi yüksek para ve sermaye piyasası araçlarından oluşacak ve portföyünün günlük olarak hesaplanan ağırlıklı ortalama vadesi en fazla 45 gün olacaktır. Fon portföyüne riskten korunmak ve/veya yatırım amacıyla türev araçlar dahil edilebilir. Türev ürünler hakkında Tebliğ ve bu izahnamede belirtilen kurallara uyulur. Yabancı yatırım araçları fon portföyüne dahil edilebilir. Ancak, fon portföyüne dahil edilen yabancı para ve sermaye piyasası araçları fon toplam değerinin %20'si ve fazlası olamaz. Fon portföyüne vadeye kalan gün sayısı hesaplanamayan varlıklar dahil edilemez.	
Özel Sektör Borçlanma Araçları		16.93%			
Ters Repo		55.42%			
Devlet Tahvili/Hazine Bono		3.72%			
Mevduat		13.44%			
Hisse Senetlerinin Sektörel Dağılımı		Yatırım Riskleri		En Az Alınabilir Pay Adeti: 1 Adet	
Hisse Senedi Verisi Bulunmamaktadır.					

B.PERFORMANS BİLGİLERİ

Yıllar	Toplam Getiri (%)	Fonun Karşılaştırma Ölçüt Getirisi (%)	Nispi Getiri (%)	Enflasyon Oranı (%)	Portföyün Zaman İçinde Standart Sapması (%)	Karşılaştırmalı Ölçütün Standart Sapması	Bilgi Rasyosu (%)	Sunuma Dahil Dönem Sonu Portföyün Toplam Değeri/Net Aktif Değeri
2016	8.07	9.50	-1.43	8.53	0.02	0.02	-0.34	67,134,702.6
2017	10.99	11.58	-0.58	11.92	0.03	0.02	-0.07	35,034,870.06
2018	17.32	17.65	-0.33	20.30	0.05	0.04	-0.02	25,986,322.59
2019	20.65	22.35	-1.70	11.84	0.05	0.04	-0.13	136,658,135.64
2020	10.45	11.08	-0.63	14.60	0.03	0.02	-0.09	129,120,647.03
2021	8.70	8.64	0.07	8.45	0.04	0.03	0.02	146,548,848.03
- 2021 yılındaki veriler, yılbaşından itibaren rapor tarihine kadar olan verilerdir. Portföyün geçmiş performansı gelecek dönem performansı için bir gösterge olamaz.								

C. DİPNOTLAR

1-Şirket faaliyet kapsamı

Fiba Port. Şekerbank Para Piyasası Fonu,Fiba Portföy Yönetimi A.Ş. tarafından yönetilmektedir.Fiba Portföy Yönetimi A.Ş. 23.07.1996 tarihinde kurulmuş olup, YatırımFonları Yönetimi, Emeklilik fonları Yönetimi ve Özel Portföy Yönetimi alanlarında faaliyet göstermektedir.

2-

Fon portföyünün yatırım amacı, stratejisi ve yatırım riskleri “A. Tanıtıcı Bilgiler” bölümünde belirtilmiştir.

3-

Fon'un 01.01.2021 - 30.06.2021 döneminde sağladığı net getiri oran : 8.7' dır.

4-

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

01.01.2021 - 30.06.2021 Döneminde	Gider Tutarı(TL)	Portföy Değerine Oranı
İhraç İzni Giderleri	7,068.27	0.01
Bağımsız Denetim Ücreti	2,277	0
Saklama Ücretleri	46,096.55	0.05
Fon Yönetim Ücreti	703,120.61	0.46
Aracılık Komisyonu Giderleri	91,269.37	0.06
Diğer Fon Giderleri	22,150.29	0.02
Toplam Harcamalar	871,982.09	0.6
DÖNEM İÇİ ORTALAMA FON TOPLAM DEĞERİ(TL)	138,278,568.87	
Toplam Faaliyet Gideri/Ortalama Fon Toplam Değeri(TL)	0.6	

5-

Bilgi Rasyosu, riske göre düzeltilmiş getiri ölçümünde kullanılır. Fonun performans dönemindeki ortalama nispi (karşılaştırma ölçütüne göre) getirisi ile günlük getiriler üzerinden hesaplanan nispi getirilerinin standart sapması olan takip hatasının oranı bilgi rasyosudur. Portföy yöneticisinin performans ölçütü üzerinde sağladığı getiriyi ölçer. Pozitif ve yüksek Bilgi Rasyosu iyi kabul edilir.

6-Fonun Ölçüt Bilgisi

Kıstas Dönemi	Kıstas Bilgileri
14.02.2013- 24.06.2013	(%50) KYD 182 Gün Bono Endeksi + (%50) KYD O/N Repo Endeksi Net
25.06.2013- 20.12.2015	(%45) KYD YTL Bono Endeksi 91 Gün + (%55) KYD ON Repo Net Endeksi
21.12.2015- 01.01.2017	(%45) KYD YTL Bono Endeksi 91 Gün + (%55) KYD ON Repo Brüt Endeksi
02.01.2017- 02.12.2018	(%30) BIST-KYD Repo (Brüt) Endeksi + (%30) BIST-KYD YTL DİBS Endeksi 91 Gün + (%40) BIST-KYD ÖSBA Sabit Endeksi
03.12.2018-	(%5) BIST-KYD ÖSBA Değişken Endeksi + (%20) BIST-KYD ÖSBA Sabit Endeksi + (%25) BIST-KYD DİBS 91 Gün + (%40) BIST-KYD Repo (Brüt) Endeksi + (%5) BIST-KYD 1 Aylık Mevduat TL Endeksi + (%5) BIST-KYD Özel Sektör Kira Sertifikaları Endeksi

7-

Yatırım fonlarının portföy işletmesinden doğan kazançları kurumlar vergisi ve stopajdan muaftır. Müşteri açısından, Gelir Vergisi Kanunu'nun geçici 67.maddesiuyarınca fon katılma payının ilgili fona iadesi % 10 oranında gelir vergisine tabidir.

-

D. İLAVE BİLGİLER VE AÇIKLAMALAR
Fonun 12.12.1996 tarihinde halka arzı gerçekleşmiştir.
Fiba Portföy Yönetimi A.Ş. Para Piyasası Fonları Şemsiye Fonu'na bağlı bir fon'dur.
Fon'un yasal gider sınırı %2,19'dur ve gider aşım olması durumunda 3 aylık dönemlerde fona iade edilen tutar ve ilgili diğer detaylar KAP'ta yayınlanmaktadır.

01.01.2021 - 30.06.2021 dönemine ait gider aşım bilgileri aşağıdaki gibidir

İade Tutarı	Kısa Vadeli Borçlanma Araçları Fonu
2017 1.Dönem	0
2017 2.Dönem	0

1) Tüm dönemler için portföy ve karşılaştırma ölçütünün birikimli getiri oranı

Dönemler	Portföy Net Getiri (%)	Portföy Brüt Getiri (%)	Karşılaştırma Ölçütü (%)	Nispi Getiri (%)
01.01.2016 - 31.12.2016	8.07	9.13	9.50	-1.43
01.01.2017 - 31.12.2017	10.99	12.07	11.58	-0.58
01.01.2018 - 31.12.2018	17.32	18.40	17.65	-0.33
01.01.2019 - 31.12.2019	20.65	21.59	22.35	-1.70
01.01.2020 - 31.12.2020	10.45	11.54	11.08	-0.63
01.01.2021 - 30.06.2021	8.70	9.21	8.64	0.07

2) Döviz Kurlarındaki Dönemsel Ortalama Getiri ve Sapma

	USD		EUR		GBP		JPY	
Dönemler	Ortalama (%)	Standart Sapma (%)	Ortalama (%)	Standart Sapma (%)	Ortalama (%)	Standart Sapma (%)	Ortalama (%)	Standart Sapma (%)
01.01.2016 - 31.12.2016	0.08	0.69	0.06	0.62	0.00	0.85	0.10	0.95
01.01.2017 - 31.12.2017	0.03	0.69	0.08	0.69	0.07	0.77	0.05	0.76
01.01.2018 - 31.12.2018	0.15	1.77	0.13	1.69	0.12	1.75	0.16	1.82
01.01.2019 - 31.12.2019	0.05	0.81	0.04	0.77	0.06	0.86	0.06	0.89
01.01.2020 - 31.12.2020	0.09	0.76	0.12	0.79	0.10	0.91	0.11	0.92
01.01.2021 - 30.06.2021	0.14	1.20	0.11	1.16	0.15	1.13	0.08	1.18

3) Portföy ve Karşılaştırma Ölçütü için Risk Ölçümleri

Dönemler	Takip Hatası	Beta	Jensen Alpha	Sharpe
01.01.2016 - 31.12.2016	0.0155	0.7256	-7345894526611.49%	-525.8707
01.01.2017 - 31.12.2017	0.0306	0.2634	-40969325797614.00%	-470.1871
01.01.2018 - 31.12.2018	0.0499	0.3759	-30672011182173200.00%	-457.6468
01.01.2019 - 31.12.2019	0.0439	0.7144	-2530918765256960.00%	-378.8281
01.01.2020 - 31.12.2020	0.0247	0.5908	29981616904931.60%	-483.8626
01.01.2021 - 30.06.2021	0.0387	0.6148	-1412009522125.34%	-206.4031

4) Performans bilgisi tablosunda rapor dönemi portföy ve karşılaştırma ölçütü standart sapmasına yer verilmiştir. (Günlük verilerden hareketle hesaplanmıştır)

Portföy			Karşılaştırma Ölçütü	
Yıllar	Getiri (%)	Standart Sapma (%)	Getiri (%)	Standart Sapma (%)
2016	8.07	0.02	9.50	0.02
2017	10.99	0.03	11.58	0.02
2018	17.32	0.05	17.65	0.04
2019	20.65	0.05	22.35	0.04
2020	10.45	0.03	11.08	0.02
2021	8.70	0.04	8.64	0.03

5) Yatırım Fonu Endeksleri Karşılaştırma Tablosu

Dönemler	Portföy (%)	Yatırım Fonu Endeksleri (%)
01.01.2016 - 31.12.2016	8.07	0.00
01.01.2017 - 31.12.2017	10.99	0.00
01.01.2018 - 31.12.2018	17.32	0.00
01.01.2019 - 31.12.2019	20.65	0.00
01.01.2020 - 31.12.2020	10.45	0.00
01.01.2021 - 30.06.2021	8.70	0.00

6) Getiri Oranını Etkileyen Piyasa Koşulları

- Dönem Getirisi	Getiri (%)
BIST 100	-8.15
BIST 30	-10.58
KYD O/N Repo Endeksi (Brüt)	9.28
KYD BONO 91 Günlük Bono Endeksi	7.44
KYD BONO 182 Günlük Bono Endeksi	7.31
KYD BONO 365 Günlük Bono Endeksi	5.82
KYD YTL Bono Endeksleri 547 Gün	3.20
KYD BONO Tüm Bono Endeksi	-0.33
KYD TL Bono Endeksleri Uzun Vade	-10.60
KYD ÖST Endeksi Sabit	8.44
KYD ÖST Endeksi Değişken	10.43
KYD Kira Sertifikaları Endeksleri Kamu	5.68
KYD Kira Sertifikaları Endeksleri Özel	8.79
KYD 1 Aylık Gösterge Mevduat Endeksi TL	8.32
KYD 1 Aylık Kar Payı Endeksi TL	6.27
Katılım 50 Endeksi	-10.89
KYD Altın Fiyat Endeksi Ağırlıklı Ort.	8.79
KYD Eurobond Bono Endeksleri USD-TL	15.42
KYD Eurobond Bono Endeksleri EUR-TL	13.40
TCMB Amerikan Doları	17.00
TCMB Euro	13.26