

Deniz Portföy Özel Sektör Borçlanma Araçlarına Yatırım Yapan %100 Anapara Korumalı İkinci Fon'NA AİT PERFORMANS SUNUM RAPORU

A. TANITICI BİLGİLER

PORTFÖYE BAKIŞ
Halka Arz Tarihi : 04.05.2021

YATIRIM VE YÖNETİME İLİŞKİN BİLGİLER

30.06.2021 tarihi itibarıyla	
Fon Toplam Değeri	13,885,025
Birim Pay Değeri (TRL)	0.958778
Yatırımcı Sayısı	137
Tedavül Oranı (%)	99.14%
Portföy Dağılımı	
Borçlanma Araçları	89.56%
- Finansman Bonosu	89.56%
Vadeli Mevduat	2.42%
Opsiyon	8.01%
Toplam	100.00%

Fon'un Yatırım Amacı	Portföy Yöneticileri
Altın'ın ons değerine yatırım yapan borsa yatırım fonunun yükselişine dayalı bir getiriden yararlanmak isteyen aynı zamanda uzun vade toleransına sahip, vade sonunda anapara koruması isteyen yatırımcı için uygundur.	MURAT ÖZKAN
En Az Alınabilir Pay Adedi : 1000 Adet	
Yatırım Stratejisi	
Yatırımcının anaparasının tamamının korunmasını, Altın'ın Amerikan Doları cinsi getirisini takip eden SPDR – Standard & Poor's Depositary Receipt Altın Borsa Yatırım Fonu'na (Altın BYF) dayalı ve izahname ve Yatırımcı Bilgi Formunda 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 yatırımının %100'ünün, yatırım döneminin sonu olan (01/06/2022) tarihinde geri ödenmesi amaçlanmaktadır. Yatırım dönemi öncesinde fondan çıkılması halinde, korumadan yararlanılamaz.	
Yatırım Riskleri	
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.	

B. PERFORMANS BİLGİSİ

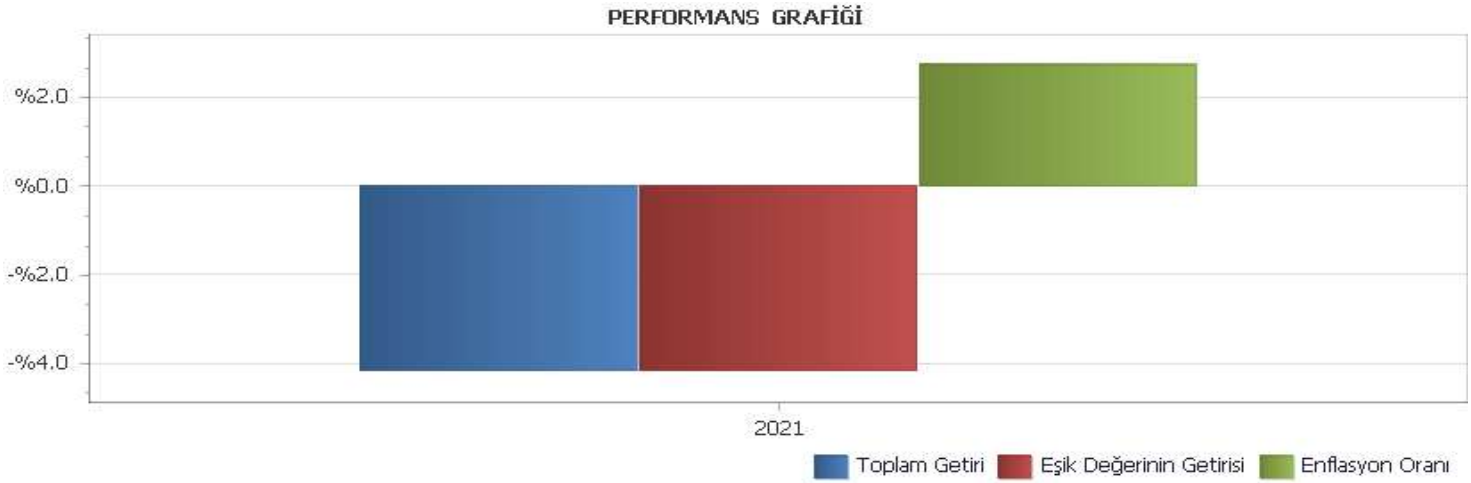
PERFORMANS BİLGİSİ							
YILLAR	Toplam Getiri (%)	Eşik Değer Getirisi (%) (***)	Enflasyon Oranı (%) (TÜFE) (*)	Portföyün Zaman İçinde Standart Sapması (%) (**)	Eşik Değerin Standart Sapması (%) (**)	Bilgi Rasyosu	Sunuma Dahil Dönem Sonu Portföyün Toplam Değeri / Net Aktif Değeri
2021 (****)	-4.164%	-0.564%	2.731%	1.715%	4.3874%	-0.2133	13,885,025.04

(*) Enflasyon oranı TÜİK tarafından açıklanan 12 aylık TÜFE'nin dönemsel oranıdır.

(**) Portföyün ve eşik değerinin standart sapması dönemindeki günlük getiriler üzerinden hesaplanmıştır.

(****) İlgili veriler 04.05.2021 tarihinden rapor tarihine kadar olan değerleri vermektedir.

(***) Portföyün karşılaştırma ölçütü/eşik değeri bulunmuyor ise dönemsel getirileri sıfır olarak raporlanmıştır. Aynı zamanda ölçüte bağlı istatistikler hesaplanmamıştır.



GEÇMİŞ GETİRİLER GELECEK DÖNEM PERFORMANSI İÇİN BİR GÖSTERGE SAYILMAZ.

C. DİPNOTLAR

1) Deniz Portföy hedeflenen getirinin yanında destek hizmet ve bütüncül yaklaşım ile yatırımcı nezdinde güvenilir ve şeffaf yönetim yapan kurum anlayışını önemsemektedir. Stratejilere yatırım alternatifleri üzerinde temel ve nicel analizlere göre yatırım komitesinin ortak görüş birliğine göre karar verilir.

2) Fon Portföyü'nün yatırım amacı, yatırımcı riskleri ve stratejisi "Tanıtıcı Bilgiler" bölümünde belirtilmiştir.

3) Fon 04.05.2021 - 30.06.2021 döneminde net %-4.16 oranında getiri sağlarken, karşılaştırma ölçütünün / eşik değerinin getirisi aynı dönemde %-0.56 olmuştur. Sonuç olarak Fon'un nispi getirisi %-3.60 olarak gerçekleşmiştir.

Toplam Getiri : Fonun ilgili dönemdeki birim pay değerindeki yüzdesel getiriyi ifade etmektedir.

Eşik Değerinin Getirisi : Fonun eşik değerinin 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.

04.05.2021 - 30.06.2021 döneminde :	Portföy Değerine Oranı (%)	TL Tutar
Fon Yönetim Ücreti	0.000880%	46,245.83
Denetim Ücreti Giderleri	0.000139%	7,294.76
Saklama Ücreti Giderleri	0.000022%	1,131.65
Aracılık Komisyonu Giderleri	0.000000%	1.54
Kurul Kayıt Ücreti	0.000008%	442.49
Diğer Faaliyet Giderleri	0.000057%	3,020.99
Toplam Faaliyet Giderleri	58,137.26	
Ortalama Fon Toplam Değeri	14,399,355.65	
Toplam Faaliyet Giderleri / Ortalama Fon Toplam Değeri	0.403749%	

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

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

D. İLAVE BİLGİLER VE AÇIKLAMALAR

1) Tüm dönemler için portföy ve eşik değerinin birikimli getiri oranı

Dönemler	Portföy Net Getiri	Portföy Brüt Getiri	Eşik Değeri	Nispi Getiri
04.05.2021 - 30.06.2021	-4.16%	-3.76%	-0.56%	-3.60%

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
04.05.2021 - 30.06.2021	0.12%	0.77%	0.09%	0.71%	0.12%	0.72%	0.10%	0.70%

3) Portföy ve Karşılaştırma Ölçütü / Eşik Değeri için Risk Ölçümleri

Dönemler	Takip Hatası	Beta
04.05.2021 - 30.06.2021	0.6907	0.1178

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

	Portföy		Eşik Değeri	
Yıllar	Getiri	Standart Sapma	Getiri	Standart Sapma
2021	-4.16%	1.72%	-0.56%	4.39%

5) Yatırım Fonu Endeksleri Karşılaştırma Tablosu

Dönemler	Portföy	Yatırım Fonu Endeksleri
04.05.2021 - 30.06.2021	-4.16%	4.00%

6) Getiri Oranını Etkileyen Piyasa Koşulları

04.05.2021 - 30.06.2021 Dönem Getirisi	Getiri
BIST 100 ENDEKSİ	-3.82%
BIST 30 ENDEKSİ	-0.70%
BIST-KYD REPO BRÜT ENDEKSİ	3.00%
BIST-KYD DİBS 91 GÜN ENDEKSİ	2.53%
BIST-KYD DİBS 182 GÜN ENDEKSİ	2.68%
BIST-KYD DİBS 365 GÜN ENDEKSİ	2.30%
BIST-KYD DİBS 547 GÜN ENDEKSİ	2.15%
BIST-KYD DİBS TÜM ENDEKSİ	3.30%
BIST-KYD DİBS UZUN ENDEKSİ	4.64%
BIST-KYD ÖSBA SABİT ENDEKSİ	2.78%
BIST-KYD ÖSBA DEĞİŞKEN ENDEKSİ	3.23%
BIST-KYD Kamu Kira Sertifikaları Endeksi	1.21%
BIST-KYD Özel Sektör Kira Sertifikaları Endeksi	2.79%
BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Mevduat Endeksi (TL)	2.73%
BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Kar Payı TL Endeksi	2.13%
Katılım 50 Endeksi	-8.73%
BIST-KYD ALTIN FİYAT AĞIRLIKLIL ORTALAMA	3.16%
BIST-KYD Eurobond USD (TL)	8.10%
BIST-KYD Eurobond EUR (TL)	5.10%
Dolar Kuru	4.47%
Euro Kuru	3.42%