

Yatırımcı Bilgi Formu

Bu form, bu Fon ile ilgili temel bilgileri ve Fon'a yatırım yapmaktan kaynaklanan riskleri içerecek şekilde sermaye piyasası mevzuatı uyarınca hazırlanmıştır. Bu form, bir satış ya da pazarlama dokümanı değildir. Fon hakkındaki temel bilgileri edinmek ve fona ilişkin temel riskleri anlayabilmek için Fon'a yatırım yapmaya karar vermeden önce bu formu okumanız tavsiye edilir.

Deniz Portföy Özel Sektör Borçlanma Araçlarına Yatırım Yapan %100 Anapara Koruma Amaçlı Birinci Fon

ISIN KODU:

Talep Toplama Dönemi: 25/04/2016 – 29/04/2016 Yatırım dönemi: 02/05/2016 – 09/06/2017 (404 gün)

Fon Hakkında

Bu fon, koruma amaçlı fondur ve bu formda belirlenen risk profilindeki yatırımcılara yöneliktir. Fon portföyü Deniz Portföy Yönetimi A.Ş. tarafından yönetilmektedir. Deniz Portföy Yönetimi A.Ş. Denizbank A.Ş.'ye ait bir şirkettir.

Yatırım Amacı ve Politikası

Fon'un yatırım stratejisi yatırım dönemi sonu olan 09/06/2017 tarihi itibarıyla,

- Yatırımcının anaparasının tamamının korunmasını,
- Petrole dayalı ve aşağıda 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, yatırımcının anaparasının %100'ünün, yatırım döneminin sonu olan 09/06/2017 tarihinde geri ödenmesi amaçlanmaktadır. Yatırım dönemi öncesinde fondan çıkılması halinde korumadan yararlanılamaz. Sadece fonun yatırım dönemi sonuna kadar fonda kalan yatırımcılar korumadan yararlanabilir.

Fonun yatırım döneminin 2 (iki) iş günü öncesi olacak olan opsiyon sözleşmesinin vade tarihinde, Brent Petrol Fiyat Getirisi negatif yani zarar olarak hesaplansa dahi getiri %0 olarak kabul edilecektir. Diğer bir değişle yatırımcılar opsiyon sözleşmesinin vade tarihinde Brent Petrol fiyatında yaşanacak bir düşüştür olumsuz etkilenmeyecektir. Bu durum, yatırımcılar için bir avantajdır. Bununla birlikte, Brent Petrol Fiyat Getirisi için bir Getiri Tavan Seviyesi bulunmaktadır. Getiri tavan seviyesinin %20 – %25 arasında gerçekleşmesi beklenmektedir. Brent Petrol fiyatındaki artışın getiri tavan seviyesinin üzerinde olması durumunda Brent petrol getirisi, getiri tavan seviyesine eşit kabul edilerek opsiyon getirisi hesaplanacaktır. Bu durum, yatırımcılar için bir dezavantajdır.

Brent cinsi Ham Petrol Amerikan Doları cinsinden fiyatlanmakla beraber Brent cinsi Ham Petrolün Amerikan Doları cinsinden fiyatında meydana gelen yüzdelik artış, getiriye katılım oranı dikkate alınarak Türk Lirası getiri olarak yansıtılacaktır. Bu nedenle yatırımcı herhangi bir kur riski taşımamaktadır.

Anapara koruması amacına yönelik olarak, portföyün yaklaşık % 90'ı ile borsada veya borsa dışında ters repo sözleşmesine ve Denizbank A.Ş. veya Deniz Finansal Kiralama A.Ş. veya Deniz Faktoring A.Ş. tarafından fona tahsisli olarak ihraç edilecek özel sektör borçlanma aracına yatırım yapılacaktır.

Fonun eşik değeri **Getiriye Katılım Oranı * Dayanak Varlık Getirisi**'dir.

- Fon portföyüne dahil edilecek olan özel sektör borçlanma aracının ihraççısının derecelendirme notuna ilişkin bilgilere

izahnamenin 2.3C bölümünde yer verilmektedir.

- Fon portföyündeki yatırım amacıyla kaldıraç yaratan işlemler dahil edilmesiyle maruz kalınan açık pozisyon tutarı, fon toplam değerini aşmaz.
- Yatırım yapılacak varlıkların belirlenmesinde Deniz Portföy Yönetimi A.Ş. yetkilidir.

Alım Satım ve Vergileme Esasları

Fon katılma payı alım satımının yapılacağı para birimi TL'dir.

Katılma payı satın almak isteyen yatırımcılar tarafından, talep toplama dönemi içinde 09:00 ile 16:00 saatleri arasında, adres ve iletişim bilgileri izahnamenin 7.7. nolu bölümünde yer alan kurumlara başvurarak "Talep Formu" doldurulur. Yatırımcılardan fon izahnamesi ve yatırımcı bilgi formunun okunup anlaşıldığı ve risklerin algılandığı bilgisini içeren pay alım talimatı alınacaktır. Yatırımcıların fon payı alımında asgari pay alım limiti 500 pay (500 TL) olup bir payın satış fiyatı 1 TL'dir. Pay alım talimatı 500 pay (500 TL) ve katları şeklinde artırılabilir. Talepler tutar üzerinden alınacaktır. Alım talimatının karşılığında tahsil edilen tutar talep dönemi süresince yatırımcı hesabında yatırımcı adına Deniz Portföy Para Piyasası Fonu ile nemalandırılır. Katılma payı alımına nema tutarı dahil edilmez. Nema tutarı, talep toplama dönemini takip eden ilk iş günü yatırımcının vadesiz mevduat hesabına geçecektir. Talep toplama döneminde iletilen alım talimatları, talep toplama döneminin son günü saat 13:30'a kadar yatırımcı tarafından iptal edilebilir.

Katılma Payı Satım Esasları: Fon pay fiyatı her ayın 2'sinde ve 16'sında olmak üzere ayda 2 kez hesaplanır ve ilan edilir. Fiyat hesaplama gününün, opsiyonun karşı tarafının bulunduğu ülke piyasası ve/veya BIST Borçlanma Araçları Piyasası ve/veya dayanak varlığının işlem gördüğü organize borsa/fiyat açıklayıcı kurum için tatil gününe denk gelmesi halinde bu piyasaların açık olduğu takip eden ilk iş günü yapılacak hesaplama dikkate alınır. Fon pay fiyatının hesaplanacağı gün saat 10:00'a kadar girilen emirler, açıklanacak fiyat üzerinden yatırımcı hesaplarına pay fiyatının hesaplandığı günden (T) 2 iş günü (T+2) sonra aktarılır. Pay fiyatının hesaplandığı gün saat 10:00'dan sonra girilen satım emirleri ise bir sonraki fiyat açıklama tarihine kadar bekletilir.

Yatırım Dönemi Sonunda Satım Bedellerinin Ödenme Esasları: Fon katılma payı bedellerinin TL tutarları fonun yatırım dönemi sonunu takip eden iş günü nakit olarak yatırımcıların dağıtıcı kuruluşlar nezdindeki hesaplarına aktarılır.

- Gerçek kişilerin fon katılma payı alım satım kazancı %10;
- tüzel kişilerin fon katılma payı alım satım kazancı %0

oranında stopaja tabidir. Bu konudaki istisnalar ve diğer detaylar için ise formun “Önemli Bilgiler” bölümü incelenmelidir.

- Fon katılma payı alım satımına aracılık edecek kuruluşlar Denizbank A.Ş. ve Deniz Yatırım Menkul Kıymetler A.Ş’dir.
- Fon katılma payları, Türkiye Elektronik Fon Dağıtım Platformu’nda işlem görmemektedir.

Risk ve Getiri Profili

Düşük Risk
Potansiyel Düşük Getiri

Yüksek risk
Potansiyel Yüksek Getiri

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

- Belirtilen risk değeri fonun yatırım yaptığı türev aracın dayanak varlığına ilişkin geçmiş veriler kullanılarak yapılan simülasyona göre belirlenmiştir ve fonun gelecekteki risk profiline ilişkin güvenilir bir gösterge olmayabilir.
- Risk değeri zaman içinde değişebilir.
- En düşük risk değeri dahi, bu Fon’a yapılan yatırımın hiçbir risk taşımadığı anlamına gelmez.
- Fon’un belirtilen risk değerine sahip olma gerekçeleri: Fon portföyünde ham petrol fiyatına dayalı opsiyon sözleşmesine yatırım yapılacak olması ve ham petrol fiyatındaki volatilité nedeniyle fon ilgili risk seviyesindedir.

Fon’un Maruz Kalacağı Temel Riskler

Faiz oranı riski, emtia fiyat riski, kredi riski, likidite riski, karşı taraf riski, operasyonel risk, kaldıraç yaratan işlem riski’dir.

Ücret, Gider ve Komisyon Bilgileri

Aşağıdaki tabloda yer alan ücret, gider ve komisyonlar Fon’un getirisini doğrudan etkiler.

A) Fon’dan karşılanan giderler	%
Yıllık azami fon toplam gider oranı	%2,19
Yönetim ücreti-Yaklaşık (yıllık)	Asgari
Kurucu (%50) ile Fon Dağıtım Kuruluşu* (%50) arasında paylaştırılacaktır.	%0,9
(Dağıtıcı kuruluşa ödenen tutar, dağıtıcı kuruluş aracılığıyla satılan Fon tutarı dikkate alınarak hesaplanır.)	Azami
	%2,05
Saklama ücreti (yaklaşık)	%0,1

Diğer giderler (Tahmini)

%0,5

Fon’un Geçmiş Performansı

- Fon’un geçmiş performansı, gelecek dönem performansı için bir gösterge olamaz.
- Fon’un kuruluş tarihi/...../.....’dir.
- Fon performansının hesaplamasında birim pay değeri esas alınmıştır.
- Fon paylarının satışına 25/04/2016 tarihinde başlanmıştır. Yatırım dönemi sonu olan 09/06/2017 tarihi itibarıyla opsiyon sözleşmesi şartlarına göre bir getiri oluşur ise, opsiyon sözleşmesi şartları ve aşağıda yer verilen kısıtlar dahilinde getiri sağlamak hedeflenmektedir. Getiriye ilişkin kısıtlar aşağıda açıklanmaktadır.
- 1) Örnek senaryolarda hesaplanan getiriler ve vade sonu değeri vergi öncesi rakamları yansıtmaktadır.
- 2) Varsayım olarak iştirak oranı, %100 olarak belirlenmiştir. İştirak oranının daha düşük gerçekleşmesi sonucunda, fon getirisi de örnek senaryolara göre daha düşük olabilecektir.
- 3) Aşağıda gösterilen örnek senaryolar geleceğe yönelik tahmin niteliğinde değildir ve senaryoların gerçekleşme olasılıkları eşit değildir.
- 4) Yatırım dönemi sona ermeden fondan çıkılması halinde fon getirisi, opsiyon getirisine esas olan getiri formülü ile değil, çıkış tarihindeki piyasa koşulları dikkate alınarak hesaplanacaktır.

Senaryo Tablosu	Kötü Senaryo	Orta Senaryo	İyi Senaryo
Brent Petrol Başlangıç Fiyatı	43,00	43,00	43,00
Brent Petrol Bitiş Fiyatı	32,00	47,00	55,00
Brent Petrol Fiyat Getirisi	%-25,58	%9,30	%27,91
Opsiyon Getirisi	%0,00	%9,30	%20,00
Getiriye Katılım Oranı	%0,00	%100,00	%100,00
Anapara Koruma Oranı	%100,00	%100,00	%100,00
Fon Getirisi	%0,00	%9,30	%20,00
100 TL’nin Yatırım Dönemi Sona Değeri	100,00	109,30	120,00

Önemli Bilgiler

Fon, Deniz Portföy Yönetimi A.Ş.’nin kurucusu olduğu Deniz Portföy Yönetimi A.Ş. Koruma Amaçlı Şemsiye Fonu’na bağlıdır. Portföy saklayıcısı Denizbank A.Ş’dir.

Fon hakkında daha fazla bilgiye, izahnameye, içtüzüğe, performans sunum raporuna, yıllık rapor ile finansal tablolara <http://www.kap.gov.tr/> ve www.denizportfoy.com adresinden ulaşılabilir.

Fon izahnamesi www.kap.gov.tr’da yayımlanmıştır. Bu husus/...../2016 tarihinde ticaret siciline tescil ettirilmiştir.

Fon katılma payı fiyatı www.denizportfoy.com da ilan edilir.

Fon, T.C. vergi düzenlemelerine tâbidir. Fonun tabi olduğu vergi düzenlemeleri ile ilgili Bakanlar Kurulu’nun 2006/10371 sayılı kararına <http://www.resmigazete.gov.tr/eskiler/2006/07/20060723-7.htm> adresinden erişilebilmektedir.

Deniz PYS’nin, bu formla ilgili sorumluluğu, formdaki yanıltıcı, yanlış ve izahname ile tutarlı olmayan bilgiler ile sınırlıdır.

Şemsiye Fon’a bağlı her bir fonun tüm varlık ve yükümlülükleri birbirinden ayrıdır.

Fon ve Deniz Portföy Yönetimi A.Ş PYS, Türkiye’de yetkilendirilmiş olup, Sermaye Piyasası Kurulu’nun gözetimine ve denetimine tâbidir.

Bu form,/...../..... tarihi itibarıyla günceldir.

DENİZ
PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.