Deniz Portföy Kira Sertifikaları Katılım Fonu'NA AİT PERFORMANS SUNUM RAPORU

A. TANITICI BİLGİLER

PORTFÖYE BAKIŞ
Halka Arz Tarihi : 28.06.2016

30.06.2021 tarihi itibarıyla	
Fon Toplam Değeri	23,523,774
Birim Pay Değeri (TRL)	1.783604
Yatırımcı Sayısı	251
Tedavül Oranı (%)	3.30%

Portföy Dağılımı	
Borçlanma Araçları	87.13%
- Özel Sektör Kira Sertifikası	77.75%
- Kamu Kira Sertifikası	9.38%
Katılım Hesabı	12.99%
Toplam	100.12%

YATIRIM VE YÖNETİME İLİŞKİN BİLGİLER

Fon'un Yatırım Amacı	Portföy Yöneticileri
Faiz ve faiz geliri içermeyen, sermaye piyasası ürünlerine yatırım yaptığından dolayı, bu tarz ürünleri tercih eden yatırımcılara sunulabilir.	HABİB YILDIRIM
En Az Alınabilir Pay Adedi : 1 Adet	

Yatırım Stratejisi

Fon'un yatırım stratejisine göre fon toplam değerinin asgari %80'i devamlı olarak kamu ve özel sektör kira sertifikalarına yatırılır.

Yatırım Riskleri

Faiz Riski: Piyasa faizlerindeki ani değişiklikler sebebiyle oluşan risktir.Piyasa Riski: Finansal varlıkların fiyatlarındaki ani hareketlerden dolayı oluşan risktir. Kredi Riski: Tahvil ve Bono ihraç eden kuruluşların anapara ve faiz geri ödemelerinde yükümlülüklerini karşılayamamaları sonucunda oluşan risktir. Karşı Taraf Riski: Borsa dışı türev araç işlemlerinde, Karşı tarafın sözleşmeden kaynaklanan yükümlülüklerini yerine getirmek istememesi ve/veya yerine getirememesi riskidir. Likidite Riski: Fon portföyünde bulunan varlıkların istenildiği anda piyasa fiyatından nakde dönüştürülememesi halinde ortaya çıkan zarar olasılığı riskidir.Operasyonel Risk: Başarısız veya yetersiz iç süreçler, insan, sistem veya dış etkenlerden kaynaklanan doğrudan veya dolaylı kayıp riskidir.Yasal Risk: Fonun halka arz edildiği dönemden sonra mevzuatta ve düzenleyici otoritelerin düzenlemelerinde meydana gelebilecek değişiklerden olumsuz etkilenmesi riskidir.

B. PERFORMANS BİLGİSİ

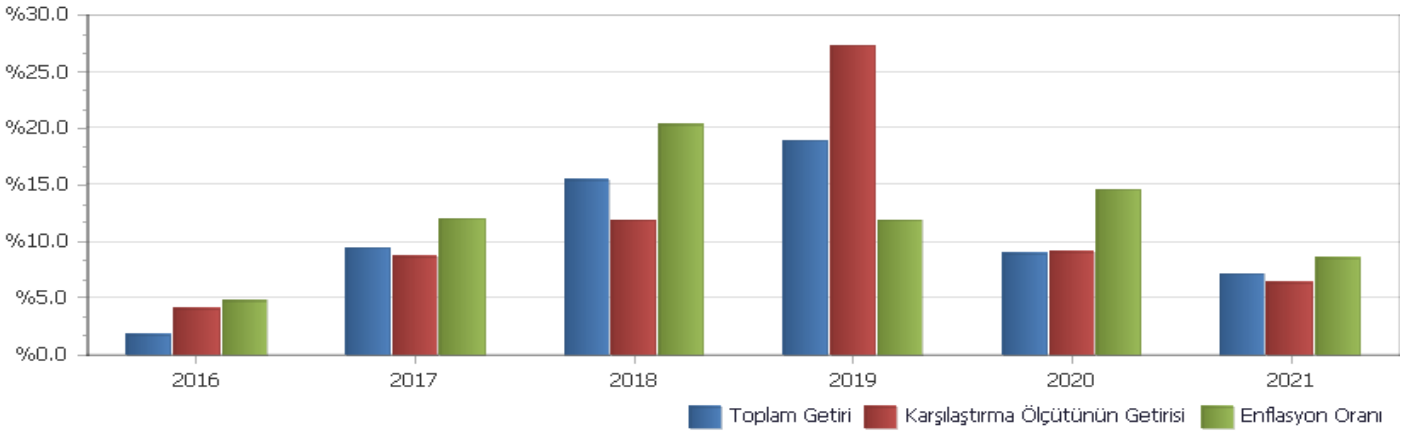
PERFORMANS BİLGİSİ							
YILLAR	Toplam Getiri (%)	Karşılaştırma Ölçütünün Getirisi (%)	Enflasyon Oranı (%) (TÜFE) (*)	Portföyün Zaman İçinde Standart Sapması (%) (**)	Karşılaştırma Ölçütünün Standart Sapması (%) (**)	Bilgi Rasyosu	Sunuma Dahil Dönem Sonu Portföyün Toplam Değeri / Net Aktif Değeri
2016	1.710%	3.970%	4.762%	0.052%	0.0567%	-0.3594	1,754,084.11
2017	9.435%	8.641%	11.920%	0.024%	0.0527%	0.0487	10,247,383.86
2018	15.465%	11.795%	20.302%	0.049%	0.1282%	0.1048	6,745,462.75
2019	18.961%	27.269%	11.836%	0.051%	0.1415%	-0.1885	33,078,321.33
2020	8.950%	9.048%	14.599%	0.034%	0.1045%	-0.0041	7,982,024.75
2021 (***)	7.077%	6.303%	8.453%	0.061%	0.0878%	0.0504	23,523,773.57

(*) 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.

PERFORMANS GRAFİĞİ



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 01.01.2021 - 30.06.2021 döneminde net %7.08 oranında getiri sağlarken, karşılaştırma ölçütünün getirisi aynı dönemde %6.30 olmuştur. Sonuç olarak Fon'un nispi getirisi %0.77 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 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.

01.01.2021 - 30.06.2021 döneminde :	Portföy Değerine Oranı (%)	TL Tutar
Fon Yönetim Ücreti	0.001463%	67,245.33
Denetim Ücreti Giderleri	0.000091%	4,175.88
Saklama Ücreti Giderleri	0.000261%	12,015.10
Aracılık Komisyonu Giderleri	0.000013%	582.82
Kurul Kayıt Ücreti	0.000042%	1,932.38
Diğer Faaliyet Giderleri	0.000190%	8,719.38
Toplam Faaliyet Giderleri	94,670.89	
Ortalama Fon Toplam Değeri	12,592,747.24	
Toplam Faaliyet Giderleri / Ortalama Fon Toplam Değeri	0.751789%	

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

Kıstas Dönemi	Kıstas Bilgisi
28.06.2016-...	%20 BIST-KYD Özel Sektör Kira Sertifikaları + %80 BIST-KYD Kamu Kira Sertifikaları

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

D. İLAVE BİLGİLER VE AÇIKLAMALAR

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

Dönemler	Portföy Net Getiri	Portföy Brüt Getiri	Karşılaştırma Ölçütü	Nispi Getiri
28.06.2016 - 30.12.2016	1.71%	2.28%	3.97%	-2.26%
02.01.2017 - 29.12.2017	9.43%	10.64%	8.64%	0.79%
02.01.2018 - 31.12.2018	15.46%	16.73%	11.80%	3.67%
02.01.2019 - 31.12.2019	18.96%	20.27%	27.27%	-8.31%
02.01.2020 - 31.12.2020	8.95%	10.32%	9.05%	-0.10%
04.01.2021 - 30.06.2021	7.08%	7.83%	6.30%	0.77%

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
28.06.2016 - 30.12.2016	0.15%	0.74%	0.11%	0.67%	0.08%	0.88%	0.04%	0.91%
02.01.2017 - 29.12.2017	0.03%	0.69%	0.08%	0.69%	0.07%	0.77%	0.05%	0.76%
02.01.2018 - 31.12.2018	0.15%	1.76%	0.13%	1.68%	0.13%	1.74%	0.16%	1.81%
02.01.2019 - 31.12.2019	0.05%	0.80%	0.04%	0.77%	0.06%	0.85%	0.06%	0.89%
02.01.2020 - 31.12.2020	0.09%	0.76%	0.13%	0.79%	0.11%	0.91%	0.11%	0.91%
04.01.2021 - 30.06.2021	0.13%	1.19%	0.11%	1.15%	0.14%	1.12%	0.08%	1.17%

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

Dönemler	Takip Hatası	Beta
28.06.2016 - 30.12.2016	0.0083	0.5471
02.01.2017 - 29.12.2017	0.0093	-0.0176
02.01.2018 - 31.12.2018	0.0195	0.1180
02.01.2019 - 31.12.2019	0.0233	0.0447
02.01.2020 - 31.12.2020	0.0161	0.0835
04.01.2021 - 30.06.2021	0.0186	-0.1456

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

	Portföy		Karşılaştırma Ölçütü	
Yıllar	Getiri	Standart Sapma	Getiri	Standart Sapma
2016	1.71%	0.05%	3.97%	0.06%
2017	9.43%	0.02%	8.64%	0.05%
2018	15.46%	0.05%	11.80%	0.13%
2019	18.96%	0.05%	27.27%	0.14%
2020	8.95%	0.03%	9.05%	0.10%
2021	7.08%	0.06%	6.30%	0.09%

5) Yatırım Fonu Endeksleri Karşılaştırma Tablosu

Dönemler	Portföy	Yatırım Fonu Endeksleri
28.06.2016 - 30.12.2016	1.71%	4.91%
02.01.2017 - 29.12.2017	9.43%	12.67%
02.01.2018 - 31.12.2018	15.46%	16.45%
02.01.2019 - 31.12.2019	18.96%	22.77%
02.01.2020 - 31.12.2020	8.95%	22.48%
04.01.2021 - 30.06.2021	7.08%	15.70%

6) Getiri Oranını Etkileyen Piyasa Koşulları

31.12.2020 - 30.06.2021 Dönem Getirisi	Getiri
BIST 100 ENDEKSİ	-5.72%
BIST 30 ENDEKSİ	-8.06%
BIST-KYD REPO BRÜT ENDEKSİ	9.28%
BIST-KYD DİBS 91 GÜN ENDEKSİ	7.44%
BIST-KYD DİBS 182 GÜN ENDEKSİ	7.31%
BIST-KYD DİBS 365 GÜN ENDEKSİ	5.82%
BIST-KYD DİBS 547 GÜN ENDEKSİ	3.20%
BIST-KYD DİBS TÜM ENDEKSİ	-0.33%
BIST-KYD DİBS UZUN ENDEKSİ	-10.60%
BIST-KYD ÖSBA SABİT ENDEKSİ	8.44%
BIST-KYD ÖSBA DEĞİŞKEN ENDEKSİ	10.43%
BIST-KYD Kamu Kira Sertifikaları Endeksi	5.68%
BIST-KYD Özel Sektör Kira Sertifikaları Endeksi	8.79%
BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Mevduat Endeksi (TL)	8.32%
BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Kar Payı TL Endeksi	6.27%
Katılım 50 Endeksi	-8.63%
BIST-KYD ALTIN FİYAT AĞIRLIKLI ORTALAMA	8.79%
BIST-KYD Eurobond USD (TL)	15.42%
BIST-KYD Eurobond EUR (TL)	13.40%
Dolar Kuru	16.99%
Euro Kuru	13.26%

7) Önceki fon yöneticisi işten ayrılmıştır.