

Global MD Portföy Capital Hisse Senedi Serbest Fon
30 Haziran 2022 Tarihinde
Sona Eren Hesap Dönemine Ait
Yatırım Performansı Konusunda
Kamuya Açıklanan Bilgilere İlişkin Rapor

Global MD Portföy Capital Hisse Senedi Serbest Fon'unun
30 Haziran 2022 Tarihinde Sona Eren Hesap Dönemine Ait
Yatırım Performansı Konusunda Kamuya Açıklanan Bilgilere İlişkin Rapor

Global MD Capital Hisse Senedi Serbest Fon'unun ("Fon") 1 Ocak 2022 – 30 Haziran 2022 dönemine ait ekteki performans sunuş raporunu Sermaye Piyasası Kurulu'nun VII-128.5 sayılı "Bireysel Portföylerin ve Kolektif Yatırım Kuruluşlarının Performans Sunumuna, Performansa Dayalı Ücretlendirmesine ve Kolektif Yatırım Kuruluşlarını Notlandırma ve Sıralama Faaliyetlerine İlişkin Esaslar Tebliği'nde ("Tebliğ") yer alan performans sunuş standartlarına ilişkin düzenlemeleri çerçevesinde incelemiş bulunuyoruz.

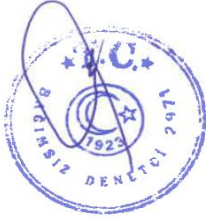
İncelememiz sadece yukarıda belirtilen döneme ait performans sunuşunu kapsamaktadır. Bunun dışında kalan dönemler için inceleme yapılmamış ve görüş oluşturulmamıştır.

İncelememiz sonucunda Fon'un 1 Ocak - 30 Haziran 2022 dönemine ait performans sunuş raporunun Tebliğ'de belirtilen performans sunuş standartlarına ilişkin düzenlemelere uygun hazırlanmadığı ile doğru ve gerçeğe uygun bir görünüm sağlamadığı kanaatine varmamıza sebep olacak herhangi bir tespitimiz bulunmamaktadır.

Diğer Husus

1 Ocak - 30 Haziran 2022 dönemine ait performans sunuş raporunda sunulan ve performans bilgisi hesaplamalarına dayanak teşkil eden finansal bilgiler Türkiye Bağımsız Denetim Standartları'na ("BDS") uygun olarak tam veya sınırlı kapsamlı bağımsız denetime tabi tutulmamıştır.

Aksis Uluslararası Bağımsız Denetim Anonim Şirketi



Çetin Dönmez , SMMM
Sorumlu Denetçi

28 Temmuz 2022
İstanbul, Türkiye

Global MD Portföy Capital Hisse Senedi Serbest Fon (Hisse Senedi Yoğun Fon)
30 Haziran 2022 Tarihi İtibarıyla Sona Eren Hesap Dönemine Ait Performans Sunuş Raporu

PORTFÖYE BAKIŞ Halka Arz Tarihi : 08.06.2022	
30.06.2022 tarihi itibarıyla	
Fon Toplam Değeri	1.232.896
Birim Pay Değeri (TRL)	0,910508
Yatırımcı Sayısı	14
Tedavül Oranı (%)	0,27%
Portföy Dağılımı	
Hisse Senedi	94,98%
TPP	5,02%
Toplam	100%

YATIRIM VE YÖNETİME İLİŞKİN BİLGİLER	
Portföy Yöneticileri	
Barış Subasar	
Nilgün Nacar	
En Az Alınabilir Pay Adedi :	1,00 Adet

Yatırım Amacı ve Stratejisi
Fon'un yatırım stratejisi: Fon, katılma payları Tebliğ'in ilgili hükümleri çerçevesinde nitelikli yatırımcılara tahsisli olarak satılacak serbest fon statüsündedir. Fon toplam değerinin en az %80'i devamlı olarak BIST'te işlem gören ortaklık paylarına ve bu ortaklık paylarına ilişkin endeksleri takip etmek üzere kurulan borsa yatırım fonları katılma paylarına yatırılır. - Fonun içerisinde yatırım yapılacak varlıkların seçimi ve ağırlıklarının belirlenmesi sürecinde yapay zeka tabanlı portföy optimizasyon modeli Magnus çıktıları baz alınır. Varlıkların geçmiş fiyatları, rakip varlıkların geçmiş fiyatları, makro ekonomik göstergeler (büyüme, enflasyon, faiz oranları, işsizlik vb.), mikro ekonomik göstergeler (piyasa değeri, PD/DD, dönem net kar veya zararı, varlıklar toplamı vb.), piyasa verileri (endeks, döviz kurları vb.), teknik analiz indikatörleri (momentum, volatilité, hacim, trend vb.), finansal modeller (Ortalama Varyans Portföy Optimizasyonu vb.), optimizasyon amaç fonksiyonları (Sharpe vb.), optimizasyon kısıtları (varlık ağırlık kısıtları vb.) ve istatistiksel modeller (Kovaryans Matrisi vb.) kullanılarak optimal portföy oluşturulur. Portföyde güncelleme önerileri periyot ve eşik değer bazlı yapılır. Piyasa koşulları ve portföy yöneticisi görüşleri doğrultusunda daha sık periyotlarda portföyde değişiklik yapılabilir. - Fon, yabancı para ve sermaye piyasası araçlarına da yatırım yapabilir. Fon portföyüne dahil edilen yerli ve yabancı ihraççıların döviz cinsinden ihraç edilmiş para ve sermaye piyasası araçları fon toplam değerinin %20 si ve fazlası olamaz. Ayrıca, fon portföyüne dahil edilen yabancı para ve sermaye piyasası araçları fon toplam değerinin %20'si ve fazlası olamaz. Fon serbest fon niteliğinde olduğu için, Performans Tebliği uyarınca, bu Tebliğ'de belirlenen eşik değer alt sınırına ilişkin esaslar uygulanmaz. Fonun maruz kalabileceği risklerin detayına Fon'un izahname belgesinden temin edilebilir. Fonun maruz kalabileceği riskler şunlardır:1) Piyasa Riski, 2) Karşı Taraf Riski, 3) Likidite Riski, 4) Kaldıraç Yaratın İşlem Riski, 5) Operasyonel Risk, 6) Yoğunlaşma Riski, 7) Korelasyon Riski, 8) Yasal Risk, 9) İhraççı Riski, 10) Baz Riski, 11) Teminat Riski, 12) İşlemin Sonuçlandırılmaması Riski, 13) Opsiyon Duyarlılık Riskleri, 14) Veri Güvenilirliği Riski, 15) Kaldıraç Riski, 16) Açığa Satış Riski, 17) Yapılandırılmış Yatırım/Borçlanma Araçları Riskleri, 18) Diğer Riskler

Global MD Portföy Capital Hisse Senedi Serbest Fon (Hisse Senedi Yoğun Fon)
30 Haziran 2022 Tarihi İtibarıyla Sona Eren Hesap Dönemine Ait Performans Sunuş Raporu

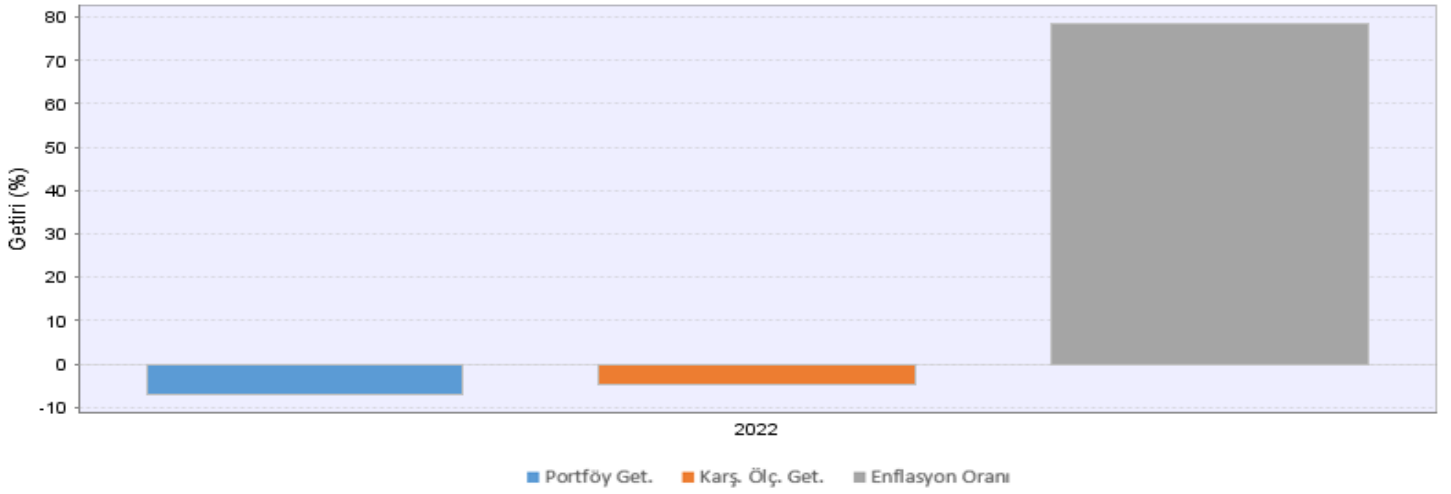
PERFORMANS BİLGİSİ							
YILLAR	Toplam Getiri (%)	Karşılaştırma Ölçütünün Getiri /Eşik Değer (%)	Enflasyon Oranı (%) (TÜFE) (*)	Portföyün Zaman İçinde Standart Sapması (%)	Karşılaştırma Ölçütünün Standart Sapması (%) (**)	Bilgi Rasyosu	Sunuma Dahil Dönem Sonu Portföyün Toplam Değeri / Net Aktif Değeri (%)
2022/06***	-5,28%	-8,07%	78,62%	1,84%	1,48%	-0,0500	1.232.896

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

(**) Portföyün ve eşik değerin standart sapması dönemdeki günlük getiriler üzerinden hesaplanmıştır. Portföyün karşılaştırma ölçütü/eşik değeri bulunmuyor ise dönemsel getirileri sıfır olarak raporlanmıştır. Aynı zamanda ölçüte bağlı istatistikler hesaplanmamıştır.

(***) 08.06.2022 – 30.06.2022 tarihleri arasındaki Fon getiri ve eşik değer getirisi gösterilmiştir. Enflasyon oranı yıllık olarak belirtilmiştir.

Portföyün geçmiş performansı gelecek dönem performansı için bir gösterge olamaz.



Fon Getirisi	-5,28%
Kıstas Getirisi	-8,07%
Enflasyon (TÜFE)	78,62%

Global MD Portföy Capital Hisse Senedi Serbest Fon (Hisse Senedi Yoğun Fon)
30 Haziran 2022 Tarihi İtibarıyla Sona Eren Hesap Dönemine Ait Performans Sunuş Raporu

DİPNOTLAR

- 1) Fon Portföyü'nün yatırım amacı, yatırımcı riskleri ve stratejisi "Tanıtıcı Bilgiler" bölümünde belirtilmiştir.
- 2) Fon 08.06.2022 - 30.06.2022 döneminde net % -5.28 oranında getiri sağlamıştır.
- 3) Yönetim ücretleri, vergi, saklama ücretleri ve diğer faaliyet giderlerinin günlük brüt portföy değerine oranının ağırlıklı ortalaması aşağıdaki gibidir.

08.06.2022 - 30.06.2022 döneminde :	Portföy Değerine Oranı (%)	TL Tutar
Fon Yönetim Ücreti	0,18%	2.202,03
Denetim ve SMMM Ücreti	0,04%	500,00
Saklama Giderleri	0,00%	9,37
Spk Kayda Alma	0,01%	61,64
Vergi, Noter Harç ve Tasdik Ücretleri	0,01%	134,70
Diğer Giderler	0,17%	1.989,30
Günlük Giderlerin Portföy Değerine Oranı	0,41%	
Ortalama Fon Toplam Değeri	1.202.453	

- 4) Performans sunum döneminde Fon'a ilişkin yatırım stratejisi değişikliği yapılmamıştır

FON karşılaştırma ölçütü kullanmamaktadır; fona eşik değer tanımlanmıştır.
Fonun Eşik Değeri; %90 BIST 100 Getiri Endeksi, %10 BIST-KYD Repo (Brüt) Endeksi'dir.