

**DENİZ PORTFÖY CC HİSSE SENEDİ
SERBEST ÖZEL FON (HİSSE SENEDİ
YOĞUN FON)**

**31 ARALIK 2022 TARİHİ İTİBARIYLA
YATIRIM PERFORMANSI KONUSUNDA
KAMUYA AÇIKLANAN BİLGİLERE
İLİŞKİN RAPOR**

DENİZ PORTFÖY CC HİSSE SENEDİ SERBEST ÖZEL FON (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON)

Deniz Portföy CC Hisse Senedi Serbest Özel Fon (Hisse Senedi Yoğun Fon)’un (“Fon”) 25 Nisan - 31 Aralık 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 Ücretlendirilmesine ve Kolektif Yatırım Kuruluşlarını Notlandırma ve Sıralama Faaliyetlerine İlişkin Esaslar Hakkında Tebliğ”’inde (“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.

Görüşümüze göre Fon’un 25 Nisan - 31 Aralık 2022 dönemine ait performans sunum raporu Deniz Portföy CC Hisse Senedi Serbest Özel Fon (Hisse Senedi Yoğun Fon)’un performansını ilgili Tebliğ’de belirtilen performans sunum standartlarına ilişkin düzenlemelere uygun olarak doğru biçimde yansıtmaktadır.

Fon’un 31 Aralık 2022 tarihi itibarıyla kamuya açıklanmak üzere ayrıca hazırlanacak yıllık finansal tabloları üzerindeki bağımsız denetim çalışmalarımız henüz tamamlanmamış olup; söz konusu finansal tablolara ilişkin bağımsız denetim çalışmalarımızın tamamlanmasını müteakiben ilgili bağımsız denetim raporumuz ayrıca tanzim edilecektir.

DRT BAĞIMSIZ DENETİM VE SERBEST MUHASEBECİ MALİ MÜŞAVİRLİK A.Ş.
Member of **DELOITTE TOUCHE TOHMATSU LIMITED**

Mehmet Erol, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 27 Ocak 2023

Deniz Portföy CC Hisse Senedi Serbest Özel Fon'NA AİT PERFORMANS SUNUM RAPORU**A. TANITICI BİLGİLER**

PORTFÖYE BAKIŞ
Halka Arz Tarihi : 25.04.2022

YATIRIM VE YÖNETİME İLİŞKİN BİLGİLER

30.12.2022 tarihi itibarıyla	
Fon Toplam Değeri	2.745.134.563
Birim Pay Değeri (TRL)	299,805727
Yatırımcı Sayısı	1
Tedavül Oranı (%)	0,61%
Portföy Dağılımı	
Ortaklık Payları	123,51%
- Gayrimenkul Yatırım Ort.	56,29%
- Petrol Ve Petrol Ürünleri	42,17%
- Holding	25,05%
Repo	-25,73%
Toplam	97,78%

Fon'un Yatırım Amacı	Portföy Yöneticileri
Özel fon olması sebebiyle yatırım başlangıcında belirlenen pay sahipleri tarafından alım satımı gerçekleştirilebilmektedir.	SERKAN TÜRK
En Az Alınabilir Pay Adedi : 0,000000 Adet	MERVE AYDOĞANLI BERKMAN
Yatırım Stratejisi	
Fon portföyüne alınacak finansal varlıklar Sermaye Piyasası Kurulu'nun düzenlemelerine ve izahnamesinde belirtilen esaslara uygun olarak seçilir.	
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.Türev Araçlardan Kaynaklanan Risk: Vadeli işlem ve opsiyon sözleşmelerinin kaldıraç etkisi nedeni ile piyasada oluşacak fiyat hareketleri sonucu anapara ve/veya teminat kayıp riskidirLikidite Riski: Fon portföyünde bulunan varlıkların istenildiği anda piyasa fiyatından nakde dönüştürülebilmesi 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 değişikliklerden olumsuz etkilenmesi riskidir.	

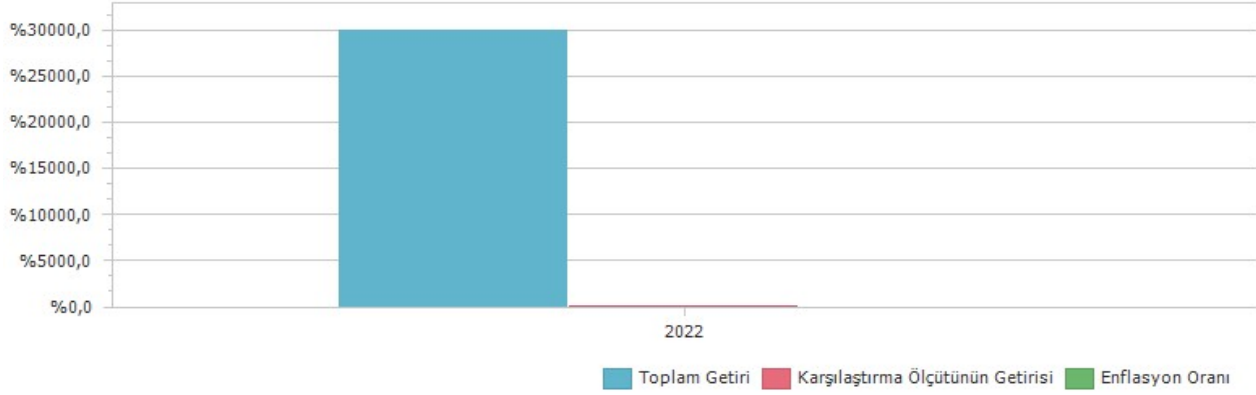
B. PERFORMANS BİLGİSİ

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
2022	30.177,932%	118,308%	26,183%	1.636,594%	3,4276%	0,1652	2.745.134.562,89

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

(**) Portföyün ve karşılaştırma ölçütünün standart sapması dönemindeki haftalık getiriler üzerinden hesaplanmıştır.

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 25.04.2022 - 30.12.2022 döneminde net %30177,93 oranında getiri sağlarken, karşılaştırma ölçütünün getirisi aynı dönemde %118,31 olmuştur. Sonuç olarak Fon'un nispi getirisi %30059,62 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 itibarıyla 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.

25.04.2022 - 30.12.2022 döneminde :	Portföy Değerine Oranı (%)	TL Tutar
Fon Yönetim Ücreti	0,000391%	1.182.935,19
Denetim Ücreti Giderleri	0,000003%	9.390,15
Saklama Ücreti Giderleri	0,000092%	279.579,02
Aracılık Komisyonu Giderleri	0,000349%	1.055.790,04
Kurul Kayıt Ücreti	0,000075%	226.994,16
Diğer Faaliyet Giderleri	0,000060%	182.232,25
Toplam Faaliyet Giderleri	2.936.920,81	
Ortalama Fon Toplam Değeri	1.210.260.745,45	
Toplam Faaliyet Giderleri / Ortalama Fon Toplam Değeri	0,242668%	

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

Kıstas Dönemi	Kıstas Bilgisi
25.04.2022-...	%5 BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Mevduat TL + %95 BIST 100 GETİRİ

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

7) Fon 17.06.2022 tarihinde %0 faiz oranıyla 1 gün vadeli (O/N) 1,899,968.57 TL tutarında kredi kullanmıştır.

8) Fon 21.06.2022 - 28.06.2022 tarihleri arasında %22,00 faiz oranıyla 1 gün vadeli (O/N) 150,000,000.00 TL tutarında kredi kullanmıştır.

9) Fon 28.06.2022 tarihinde %22,00 faiz oranıyla 1 gün vadeli (O/N) 130,000,000.00 TL tutarında kredi kullanmıştır.

10) Fon 29.06.2022 - 01.07.2022 tarihleri arasında %23,00 faiz oranıyla 1 gün vadeli (O/N) 130,000,000.00 TL tutarında kredi kullanmıştır.

11) Fon 01.07.2022 - 26.07.2022 tarihleri arasında %23,00 faiz oranıyla 1 gün vadeli (O/N) 130,000,000.00 TL tutarında kredi kullanmıştır.

12) Fon 26.07.2022 - 27.07.2022 tarihleri arasında %23,00 faiz oranıyla 1 gün vadeli (O/N) 130.136.805.56 TL tutarında kredi kullanmıştır.

13) Fon 27.07.2022 - 11.08.2022 tarihleri arasında %24,00 faiz oranıyla 1 gün vadeli (O/N) 130.000.000.00 TL tutarında kredi kullanmıştır.

14) Fon 11.08.2022 - 29.11.2022 tarihleri arasında %21,50 faiz oranıyla 1 gün vadeli (O/N) 130.000.000.00 TL tutarında kredi kullanmıştır.

21) Fon 29.11.2022 - 12.12.2022 tarihleri arasında %22,125 faiz oranıyla 1 gün vadeli (O/N) 200.000.000.00 TL tutarında kredi kullanmıştır.

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
25.04.2022 - 30.12.2022	30.177,93%	30178,174941286600%	118,31%	30.059,62%

2) Döviz Kurlarındaki Dönemsel Ortalama Getiri ve Sapma

Dönemler	USD		EUR		GBP		JPY	
	Ortalama	Standart Sapma	Ortalama	Standart Sapma	Ortalama	Standart Sapma	Ortalama	Standart Sapma
25.04.2022 - 30.12.2022	0,14%	0,48%	0,13%	0,75%	0,10%	0,91%	0,13%	0,90%

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

Dönemler	Takip Hatası	Beta
25.04.2022 - 30.12.2022	259,9109	-65,3909

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

Yıllar	Portföy		Karşılaştırma Ölçütü	
	Getiri	Standart Sapma	Getiri	Standart Sapma
2022	30177,93%	1636,59%	118,31%	3,43%

5) Yatırım Fonu Endeksleri Karşılaştırma Tablosu

Dönemler	Portföy	Yatırım Fonu Endeksleri
25.04.2022 - 30.12.2022	30177,93%	134,79%

6) Getiri Oranını Etkileyen Piyasa Koşulları

25.04.2022 - 30.12.2022 Dönem Getirisi	Getiri
BIST 100 ENDEKSİ	123,95%
BIST 30 ENDEKSİ	115,63%
BIST-KYD REPO BRÜT ENDEKSİ	9,12%
BIST-KYD DİBS 91 GÜN ENDEKSİ	12,43%
BIST-KYD DİBS 182 GÜN ENDEKSİ	17,04%
BIST-KYD DİBS 365 GÜN ENDEKSİ	24,77%
BIST-KYD DİBS 547 GÜN ENDEKSİ	30,08%
BIST-KYD DİBS TÜM ENDEKSİ	45,33%
BIST-KYD DİBS UZUN ENDEKSİ	76,37%
BIST-KYD ÖSBA SABİT ENDEKSİ	15,70%
BIST-KYD ÖSBA DEĞİŞKEN ENDEKSİ	12,62%
BIST-KYD Kamu Kira Sertifikaları Endeksi	19,85%
BIST-KYD Özel Sektör Kira Sertifikaları Endeksi	14,69%
BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Mevduat Endeksi (TL)	11,05%
BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Kar Payı TL Endeksi	12,01%
Katılım 50 Endeksi	138,97%
BIST-KYD ALTIN FİYAT AĞIRLIKLIL ORTALAMA	19,79%
BIST-KYD Eurobond USD (TL)	32,91%
BIST-KYD Eurobond EUR (TL)	29,49%
Dolar Kuru	26,82%
Euro Kuru	25,96%