

**DENİZ PORTFÖY MUTLAK GETİRİ
HEDEFLİ HİSSE SENEDİ SERBEST FON
(HİSSE SENEDİ YOĞUN FON)**

**31 ARALIK 2024 TARİHİ İTİBARIYLA
YATIRIM PERFORMANSI KONUSUNDA
KAMUYA AÇIKLANAN BİLGİLERE
İLİŞKİN RAPOR**

DENİZ PORTFÖY MUTLAK GETİRİ HEDEFLİ HİSSE SENEDİ SERBEST FON (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON)

Deniz Portföy Mutlak Getiri Hedefli Hisse Senedi Serbest Fon (Hisse Senedi Yoğun Fon)’unun (“Fon”) 23 Aralık 2024 - 31 Aralık 2024 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 23 Aralık 2024 - 31 Aralık 2024 dönemine ait performans sunum raporun Deniz Portföy Mutlak Getiri Hedefli Hisse Senedi Serbest Fon (Hisse Senedi Yoğun Fon)’un performansının Tebliğ’de belirtilen performans sunum standartlarına ilişkin düzenlemelere uygun olarak doğru biçimde yansıtmaktadır.

Fon’un 31 Aralık 2024 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 raporunuz ayrıca tanzim edilecektir.

Dikkat Çekilen Husus

23 Aralık 2024 - 31 Aralık 2024 dönemine ait performans sunuş raporunda sunulan ve performans bilgisi hesaplamalarına dayanak teşkil eden finansal bilgiler, TMS 29 - Yüksek Enflasyonlu Ekonomilerde Finansal Raporlama standardı uygulanmadan hazırlanmıştır. Bu husus görüşümüzü etkilememektedir.

DRT BAĞIMSIZ DENETİM VE SERBEST MUHASEBECİ MALİ MÜŞAVİRLİK A.Ş.

Member of **DELOITTE TOUCHE TOHMATSU LIMITED**

Burç Seven, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 31 Ocak 2025

Deniz Portföy Mutlak Getiri Hedefli Hisse Senedi Serbest Fon (Hisse Senedi Yoğun Fon)'NA AİT PERFORMANS SUNUM RAPORU

A. TANITICI BİLGİLER

PORTFÖYE BAKIŞ
Halka Arz Tarihi : 23.12.2024

YATIRIM VE YÖNETİME İLİŞKİN BİLGİLER

31.12.2024 tarihi itibarıyla	
Fon Toplam Değeri	16.911.628
Birim Pay Değeri (TRL)	1,011042
Yatırımcı Sayısı	46
Tedavül Oranı (%)	0,84%
Portföy Dağılımı	
Ortaklık Payları	84,16%
- Bankacılık	18,21%
- Holding	14,73%
- Gayrimenkul Yatırım Ort.	14,04%
- Hava Yolları Ve Hizmetleri	13,18%
- İletişim	8,97%
- Otomotiv	7,99%
- Elektrik	7,03%
Teminat	10,82%
Takasbank Para Piyasası İşlemleri	4,14%
Vadeli Mevduat	0,89%
Futures	0,00%
Toplam	100,00%

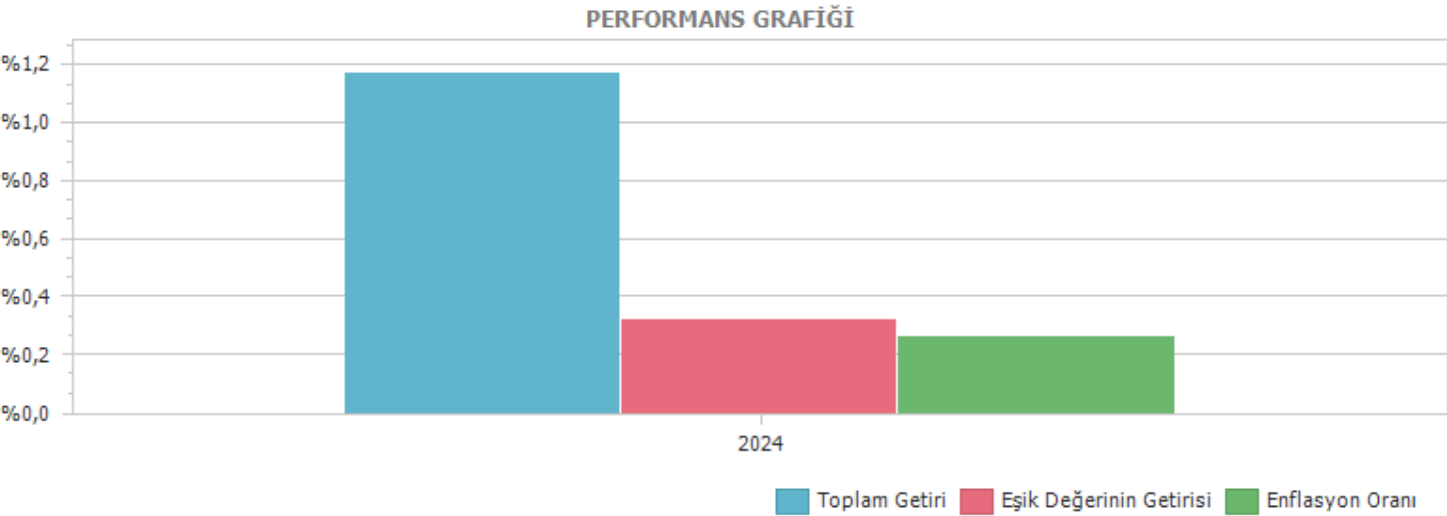
Fon'un Yatırım Amacı	Portföy Yöneticileri
	HAKAN DEPREM
En Az Alınabilir Pay Adedi : 1 Adet	ERKAN BOZBAYINDIR
	HÜSEYİN ÇALIŞ
Yatırım Stratejisi	
Fon'un ana yatırım stratejisi uyarınca Fon toplam değerinin en az %80'i devamlı olarak BIST'te işlem gören ortaklık paylarına ve bu paylardan oluşan endeksleri takip etmek üzere kurulan borsa yatırım fonları katılma paylarına yatırılır. Ayrıca, Fon'un hisse senedi yoğun fon olması nedeniyle Fon portföy değerinin en az %80'i devamlı olarak menkul kıymet yatırım ortaklıkları payları hariç olmak üzere BIST'te işlem gören ihraççı paylarına, ihraççı paylarına ve pay endekslerine dayalı olarak yapılan vadeli işlem sözleşmelerinin nakit teminatlarına, ihraççı paylarına ve pay endekslerine dayalı opsiyon sözleşmelerinin primleri ile borsada işlem gören ihraççı paylarına ve pay endekslerine dayalı aracı kuruluş varantlarına ve ihraççı paylarından oluşan endeksleri 27/11/2013 tarihli ve 28834 sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan Borsa Yatırım Fonlarına İlişkin Esaslar Tebliği (III-52.2)'nin 5 inci maddesinin dördüncü fıkrasının (a) bendi kapsamında takip etmek üzere kurulan borsa yatırım fonu paylarına 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. Türev Araçlardan Kaynaklanan Risk: Vadeli işlem ve opsiyon sözleşmelerinin kaldırıcı etkisi nedeni ile piyasada oluşacak fiyat hareketleri sonucu anapara ve/veya teminat kayıp 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 değişikliklerden olumsuz etkilenmesi riskidir.	

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
2024	1,175%	0,325%	0,264%	1,137%	0,1714%	0,1608	16.911.628,41

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

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



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 24.12.2024 - 31.12.2024 döneminde net %1,18 oranında getiri sağlarken, eşik değerinin getirisi aynı dönemde %0,32 olmuştur. Sonuç olarak Fon'un nispi getirisi %0,85 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.

24.12.2024 - 31.12.2024 döneminde :	Portföy Değerine Oranı (%)	TL Tutar
Fon Yönetim Ücreti	0,005586%	7.243,05
Denetim Ücreti Giderleri	0,046806%	60.691,68
Saklama Ücreti Giderleri	0,000240%	311,08
Aracılık Komisyonu Giderleri	0,043484%	56.383,94
Kurul Kayıt Ücreti	0,000057%	73,53
Diğer Faaliyet Giderleri	0,002927%	3.794,86
Toplam Faaliyet Giderleri	128.498,14	
Ortalama Fon Toplam Değeri	14.407.372,42	
Toplam Faaliyet Giderleri / Ortalama Fon Toplam Değeri	0,891892%	

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

Kıstas Dönemi	Kıstas Bilgisi
24.12.2024-1.01.2025	%100 BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Mevduat USD + %1 (20/12/2024) (TL)

- 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
24.12.2024 - 31.12.2024	1,18%	2,07%	0,32%	0,85%

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

Dönemler	Takip Hatası	Beta
24.12.2024 - 31.12.2024	0,0246	2,5531

24.12.2024 - 31.12.2024 Dönem Getirisi	Getiri
BIST 100 ENDEKSİ	1,63%
BIST 30 ENDEKSİ	1,96%
BIST-KYD REPO BRÜT ENDEKSİ	1,06%
BIST-KYD DİBS 91 GÜN ENDEKSİ	0,77%
BIST-KYD DİBS 182 GÜN ENDEKSİ	0,00%
BIST-KYD DİBS 365 GÜN ENDEKSİ	2,17%
BIST-KYD DİBS 547 GÜN ENDEKSİ	2,00%
BIST-KYD DİBS TÜM ENDEKSİ	2,34%
BIST-KYD DİBS UZUN ENDEKSİ	3,21%
BIST-KYD ÖSBA SABİT ENDEKSİ	0,83%
BIST-KYD ÖSBA DEĞİŞKEN ENDEKSİ	0,99%
BIST-KYD Kamu Kira Sertifikaları Endeksi	0,47%
BIST-KYD Özel Sektör Kira Sertifikaları Endeksi	0,76%
BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Mevduat Endeksi (TL)	0,97%
BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Kar Payı TL Endeksi	0,77%
BIST Katılım 50 GETİRİ ENDEKSİ	2,11%
BIST-KYD ALTIN FİYAT AĞIRLIKLIL ORTALAMA	0,52%
BIST-KYD Eurobond USD (TL)	0,34%
BIST-KYD Eurobond EUR (TL)	0,35%
Dolar Kuru	0,28%
Euro Kuru	0,46%