AKTİF PORTFÖY HİSSE SENEDİ (TL) FONU (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON)

31 ARALIK 2023 TARİHİ İTİBARIYLA YATIRIM PERFORMANSI KONUSUNDA KAMUYA AÇIKLANAN BİLGİLERE İLİŞKİN RAPOR



DRT Bağımsız Denetim ve Serbest Muhasebeci Mali Müşavirlik A.Ş. Maslak no1 Plaza Eski Büyükdere Caddesi Maslak Mahallesi No:1 Maslak, Sarıyer 34485 İstanbul, Türkiye

Tel: +90 (212) 366 6000 Fax: +90 (212) 366 6010 www.deloitte.com.tr

Mersis No: 0291001097600016 Ticari Sicil No : 304099

# AKTİF PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş. AKTİF PORTFÖY HİSSE SENEDİ (TL) FONU (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON) YATIRIM PERFORMANSI KONUSUNDA KAMUYA AÇIKLANAN BİLGİLERE İLİŞKİN RAPOR

Aktif Portföy Yönetimi A.Ş Aktif Portföy Hisse Senedi (TL) (Hisse Senedi Yoğun Fon) Fon'unun ("Fon") 11 Mayıs – 31 Aralık 2023 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 11 Mayıs - 31 Aralık 2023 dönemine ait performans sunuş raporu Aktif Portföy Yönetimi A.Ş. Aktif Portföy Hisse Senedi (TL) (Hisse Senedi Yoğun Fon) Fon'unun performansını ilgili Tebliğ'de belirtilen performans sunuş standartlarına ilişkin düzenlemelere uygun olarak doğru bir biçimde yansıtmaktadır.

### Diğer Husus

Fon'un kamuya açıklanmak üzere 31 Aralık 2023 tarihinde sona eren hesap dönemine ait Sermaye Piyasası Kurulu'nun Seri: II-14.1 sayılı "Sermaye Piyasasında Finansal Raporlamaya İlişkin Esaslar Tebliği'ne uygun olarak ve Sermaye Piyasası Kurulu Karar Organı'nın 28 Aralık 2023 tarih ve 81/1820 sayılı kararı uyarınca TMS 29 dahil olmak üzere Türkiye Finansal Raporlama Standartları'na ("TFRS") göre hazırlanacak finansal tablolarına ilişkin bağımsız denetim çalışmalarımız henüz tamamlanmamış olup, çalışmalarımızın tamamlanmasını müteakip söz konusu finansal tablolar hakkındaki bağımsız denetçi raporumuz ayrıca düzenlenecektir. Dolayısıyla ekteki performans sunuş raporu, bağımsız denetime tabi tutulacak ve enflasyona göre düzeltilecek olan finansal tablolardan farklılık arz eden finansal tablolar baz alınarak Fon tarafından hazırlanmıştır.

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

Volkan Becerik, SMMM Sorumlu Denetçi

İstanbul, 31 Ocak 2024

Deloitte; İngiltere mevzuatına göre kurulmuş olan Deloitte Touche Tohmatsu Limited ("DTTL") şirketini, üye firma ağındaki şirketlerden ve ilişkili tüzel kişiliklerden bir veya birden fazlasını ifade etmektedir. DTTL ve üye firmalarının her biri ayrı ve bağımsız birer tüzel kişiliklir. DTTL ("Deloitte Global" olarak da anılmaktadır) müşterilere hizmet sunmamaktadır. Global üye firma ağımızla ilgili daha fazla bilgi almak için www.deloitte.com/about adresini ziyaret ediniz

© 2024. Daha fazla bilgi için Deloitte Türkiye (Deloitte Touche Tohmatsu Limited üye şirketi) ile iletişime geçiniz.

### AKTIF PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş. TARAFINDAN YÖNETİLEN ASJ - AKTIF PORTFÖY HİSSE SENEDİ (TL) FONU 01.01.2023-31.12.2023 DÖNEMİNE AİT PERFORMANS SUNUM RAPORU

## A. TANITICI BİLGİLER

		Portföy Yöneticileri	
	Fonun Yatırım Amacı	Yasin Atikler	
63.909.306,99	Fon toplam değerinin en az %80'i devamlı olarak yerli ihraççıların ortaklık	Ali Kıvanç Manzakoğlu Sinan Soyalp Burcu Atar Sönmez Mehmet Alp Ertekin Mehmet Batuhan Şermet Nur Şenol Sarı	
1,879458	paylarına ve bu ortaklık paylarından oluşan endeksleri takip etmek üzere		
995	kurulan borsa yatırım fonu katılma paylarına yatırılır.		
6,80%			
88,83%		En Az Alınabilir Pay Adedi	
6,48%	En Az Alinabilir Pay		
4,69%		1	
	Yatırım Stratejisi		
18,68% 13,99% 10,51% 8,41%	yatırım ortaklıkları payları hariç olmak üzere BİST'te işlem gören ihraççı payları, ihraççı paylarına ve ihraççı payı endekslerine dayalı olarak yapılan vadeli işlem sözleşmelerinin nakit teminatları, ihraççı paylarına ve pay endekslerine dayalı opsiyon sözleşmelerinin primleri, borsada işlem gören ihraççı paylarına ve pay endekslerine dayalı aracı kuruluş varantları ile en az %80'i devamlı olarak BIST'te işlem gören ihraççı paylarından oluşan endeksleri takip etmek üzere kurulan borsa yatırım fonu katılma paylarına yatırılır.		
7,20% 6,35%	Yatırım Riskleri		
4,37%	Fonun risk değeri "6"'dır.		
4,36%	- En az risk 1, en fazla risk 7 olmak üzere risk değeri 1-7 arasındadır.		
3,89%	gelecekteki risk profiline ilişkin güvenilir bir gösterge olmayabilir Risk değeri zaman içinde değişebilir En düşük risk değeri dahi, bu fona yapılan yatırımın hiçbir risk taşımadığı anlamına gelmez Fon'un belirtilen risk değerine sahip olma gerekçeleri: Fon portföyünde, ağırlıklı olarak yerli ve yabancı ihraççıların döviz cinsinden ihraç edilmiş para ve sermaye piyasası araçlarına yatırım yapılması nedeni ile "6" risk değerine		
3,73%			
3,33%			
2,03%			
1,98%			
	1,879458 995 6,80% 88,83% 6,48% 4,69% 13,99% 10,51% 8,41% 7,20% 6,35% 4,37% 4,36% 3,89% 3,73% 3,33% 2,03%	Fon toplam değerinin en az %80'i devamlı olarak yerli ihraççıların ortaklık paylarına ve bu ortaklık paylarından oluşan endeksleri takip etmek üzere kurulan borsa yatırım fonu katılma paylarına yatırılır.    Samalar   Samalar   Samalar   Samaları   Sama	

# AKTIF PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş. TARAFINDAN YÖNETİLEN ASJ - AKTIF PORTFÖY HİSSE SENEDİ (TL) FONU 01.01.2023-31.12.2023 DÖNEMİNE AİT PERFORMANS SUNUM RAPORU

#### B. PERFORMANS BILGISI

PERFORMANS	TOPLAM GETİRİ (%)	OLCUTUNUN GETIRISI	ENFLASYON ORANI (***)	** PORTFÖYÜN STANDART	** KARŞILAŞTIRMA ÖLCÜTÜNÜN STANDART	BİLGİ	SUNUMA DAHİI FON PORTFÖ NET AKTİF I	Y DEĞERİ &
DÖNEMİ	TOPLAN GETIN (78)		SAPMASI (%)	SAPMASI	RASYOSU	PORTFÖY DEĞERİ	NET AKTİF DEĞERİ	
2023	87,95%	51,91%	42,98%	2,04%	1,90%	22,93%	64.245.043,66	63.909.306,99

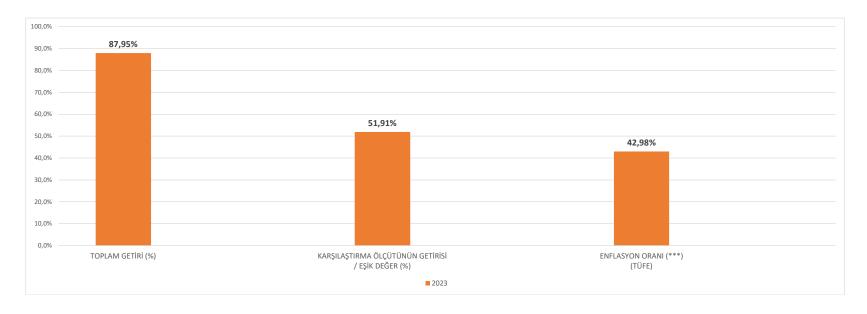
<sup>\*</sup> Fon 11.05.2023 tarihinde halka arz edilmiştir.

#### Bilgi Rasyosu:

31.12.2023 tarihinde Fon'un Bilgi Rasyosu %22,93 olarak hesaplanmıştır.

Riske göre düzeltilmiş getirinin hesaplanmasında "Bilgi Rasyosu" (Information Ratio) kullanılmıştır. Bilgi rasyosu, fonun günlük getiri oranı ile karşılaştırma ölçütünün günlük getiri oranı/eşik değer farklarının performans dönemi boyunca ortalamasının, fonun günlük getiri oranı ile karşılaştırma ölçütünün günlük getiri oranı/eşik değer farklarının performans dönemi boyunca standart sapmasına oranı olarak hesaplanmaktadır. Pozitif ve istikrarlı bilgi rasyosu hedeflenir.

#### GECMİŞ GETİRİLER GELECEK DÖNEM PERFORMANSI İÇİN BİR GÖSTERGE SAYILMAZ.



<sup>\*\*</sup> Portföyün ve karşılaştırma ölçütünün standart sapması dönemdeki günlük getiriler üzerinden hesaplanmıştır.

<sup>\*\*\*</sup> TÜFE oranı verilmiştir.

# AKTIF PORTFÖY YÖNETIMI A.Ş. TARAFINDAN YÖNETİLEN ASJ - AKTIF PORTFÖY HİSSE SENEDİ (TL) FONU 01.01.2023-31.12.2023 DÖNEMİNE AİT PERFORMANS SUNUM RAPORU

#### C. DIPNOTLAR

ASJ- AKTİF PORTFÖY HİSSE SENEDİ (TL) FON , Aktif Portföy Yönetimi A.Ş. tarafından yönetilmektedir.

Aktif Portföy Yönetimi A.Ş. ("Şirket") 24 Haziran 2016 tarihinde kurulup tescil edilmiş bir şirkettir. Şirket Aktif Yatırım Bankası A.Ş. (%91,86) ve Banka Kombetare Tregtare Kosova (%8,14) işbirliğiyle faaliyetlerine devam etmektedir.

Şirketin amacı; sermaye piyasası kanunu ile ilgili mevzuat hükümleri çerçevesinde sermaye piyasası araçlarından oluşan portföyleri müşterilerle portföy yönetim sözleşmesi yapmak suretiyle vekil sıfatı ile yönetmek ve sermaye piyasası faaliyetlerinde bulunmaktadır. Şirket ayrıca Portföy yöneticiliği faaliyeti kapsamında yerli ve yabancı fonları, yatırım ortaklıkları ile yerli veya yabancı özel ve tüzel kişilerle yatırım şirketleri ve benzeri girişimlerin portföylerini de mevzuat hükümleri çerçevesinde yönetmektedir.

31.12.2023 tarihi itibariyle 23 adet yatırım fonu, 8 adet emeklilik yatırım fonu, 2 adet gayrimenkul yatırım fonu ve 5 adet girişim sermayesi yatırım fonu yönetmektedir. Toplam yönetilen varlık büyüklüğü 31.12.2023 tarihi itibariyle 21.046.591.581-TL'dir.

- 2. Fon Portföyünün yatırım amacı, stratejisi ve yatırım riskleri "A. Tanıtıcı Bilgiler" kısmında belirtilmiştir.
- 3. Fonun 11.05.2023 31.12.2023 tarihleri arasında sağladığı net getiri oranı : 87,95% Fonun 11.05.2023 31.12.2023 dönem getirisini etkileyen piyasa koşullarını yansıtan yatırım ürünleri getirileri aşağıda yer almaktadır:

11.05.2023 - 31.12.2023	Getiri (%)
BIST 100	54,09%
BIST 30	48,55%
USD KURU (Alış)	50,66%
EURO KURU (Alış)	52,55%
EURO/USD	1,25%
KYD 1 Aylık Mevduat Endeksi (TL)	20,89%

4. Yönetim ücretleri, vergi, saklama ücretleri ve diğer faaliyet giderlerinin günlük brüt varlık değerlere oranının ağırlıklı ortalaması aşağıdaki gibidir;

Açıklama	(TL)	Toplam Portföy Giderlerine Oranı (%)
Noter Harç ve Tasdik Giderleri	777,71	0,08
Bağımsız Denetim Ücreti	28.813,00	2,85
Saklama Giderleri	4.322,83	0,43
Fon Yönetim Ücreti	879.405,69	86,88
Kurul Kayıt Ücreti	7.781,34	0,77
Vergi, Resim, Harç vb. Giderler	3.588,40	0,35
Aracı Kurumlara Ödenen Komisyonlar	53.387,51	5,27
Diğer Giderler	34.083,05	3,37
Toplam Giderler	1.012.159,53	2,00
Ortalama Fon Toplam Değeri	50.592.591,04	
Toplam Giderlerin Ortalama Fon Toplam Değerine Oranı (%)	2,00	

5. Performans sunum döneminde Fon'un yatırım stratejisi ve bant aralığında herhangi bir değişiklik olmamıştır.

Dönem	Karşılaştırma Ölçütü/Eşik Değer	Fon Getirisi (%)	Karşılaştırma Ölçütü Getirisi (%)	
	%90 BIST-100 (Getiri) Endeksi %10 BIST-KYD 1 Aylık Mevduat TL Endeksi	87,95%	51,91%	

# AKTIF PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş. TARAFINDAN YÖNETİLEN ASJ - AKTIF PORTFÖY HİSSE SENEDİ (TL) FONU 01.01.2023-31.12.2023 DÖNEMİNE AİT PERFORMANS SUNUM RAPORU

### D. İLAVE BİLGİLER VE AÇIKLAMALAR

1.	Başlangıç Tarihi	11.05.2023
	Rapor Tarihi	31.12.2023
	Gün Sayısı	235
	Fon'un Getirisi	87,95%
	Hedeflenen Karşılaştırma Ölçütü Getirisi (%)	51,91%
	Gerçekleşen Karşılaştırma Ölçütü Getirisi (%)	51,91%
	*Nispi Getiri (%)	36,04%

<sup>\*</sup>Nispi Getiri = (Gerçekleşen Getiri - Gerçekleşen Karşılaştırma Ölçütünün Getirisi) + (Gerçekleşen Karşılaştırma Ölçütünün Getirisi - Hedeflenen Karşılaştırma Ölçütünün Getirisi)

Fon Halka Arz Tarihi	11.05.2023
Rapor Tarihi	31.12.2023
İlk Fiyat Tarihi İtibariyle Fon Getirisi (%)	87,95%

- 2. Döviz kurlarının dönemsel getirileri 3. Dipnot'ta yer almaktadır.
- 3. Performans Bilgisi tablosunda rapor dönemi portföy ve karşılaştırma ölçütü yıllık getirilerin standart sapmasına ve bilgi rasyosuna yer verilmiştir.
- 4. Brüt Fon Getirisi, toplam giderlerden kurucu tarafından karşılanan giderler düşürülerek bulunmaktadır. Aşağıda gösterilmektedir.

Net Basit Getiri (%):	87,95%
* Gerçekleşen Fon Toplam Gider Oranı (%) :	2,00%
Azami Toplam Gider Oranı (%):	3,65%
** Kurucu Tarafından Karşılanan Gider Oranı:	0,00%
Net Gider Oranı (%):	2,00%
Brüt Getiri (%):	89,95%

<sup>\*</sup> Kurucu tarafından karşılananlarda dahil tüm fon giderlerinin ortalama net varlık değerine oranıdır.

<sup>\*\*</sup> Azami Fon Toplam Gider Oranın aşılması nedeniyle kurucu tarafından dönem sonunu takip eden 5 iş günü içinde fona iade edilen giderlerin ortalama fon net varlık değerine oranını ifade etmektedir.