

**ROTA PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.  
TARAFINDAN KURULAN VE YÖNETİLEN  
ROTA PORTFÖY İKİNCİ PARA PİYASASI FONU**

**1 OCAK 2024 - 30 HAZİRAN 2024 DÖNEMİNE AİT  
PERFORMANS SUNUM RAPORU**

Rapor No: SBD/ 302-57

**Rota Portföy İkinci Para Piyasası Fonu  
Yatırım Performansı Konusunda Kamuya Açıklanan Bilgilere İlişkin Rapor**

Rota Portföy İkinci Para Piyasası Fonu'nun ("Fon") 1 Ocak – 30 Haziran 2024 dönemine ilişkin ekte yer alan Performans Sunuş Raporu, 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 ilişkin Esaslar Hakkında Tebliğ'inde ("Tebliğ") yer alan performans sunuş standartlarına ilişkin düzenlemelerine göre tarafımızca incelenmiştir.

Gerçekleştirmiş olduğumuz inceleme, yukarıda belirtilen döneme ait performans sunuşunu kapsamaktadır. Bu dönem dışında kalan dönemler için bir inceleme yapılmamıştır ve görüş oluşturulmamıştır.

Görüşümüz: 1 Ocak – 30 Haziran 2024 dönemine ait oluşturulmuş olan performans sunuş raporu Fon'un performansını, Tebliğ'de belirtilen performans sunuş standartlarına dair düzenlemelere göre uygun ve doğru olarak hazırlanmıştır.

**Diğer Hususlar**

1 Ocak – 30 Haziran 2024 dönemine ait performans sunuş raporunda sunulan ve performans bilgi hesaplamalarına dayanak teşkil eden finansal bilgiler Türkiye Bağımsız Denetim Standartları'na ("TDS") uygun olarak tam veya sınırlı kapsamlı denetime tabi tutulmamıştır.

**HLB SAYGIN BAĞIMSIZ DENETİM A.Ş.**  
(A member of HLB International)



Servet Gür EYÜPGİLLER, SMMM

Sorumlu Denetçi

İSTANBUL, 31 Temmuz 2024

## ROTA PORTFÖY İKİNCİ PARA PİYASASI FONU'NA AİT PERFORMANS SUNUM RAPORU

### A. TANITICI BİLGİLER

PORTFÖYE BAKIŞ  
Halka Arz Tarihi : 27.06.2024

### YATIRIM VE YÖNETİME İLİŞKİN BİLGİLER

28.06.2024 tarihi itibarıyla	
Fon Toplam Değeri	13.141.652
Birim Pay Değeri (TRL)	1,004285
Yatırımcı Sayısı	14
Tedavül Oranı (%)	1,31%
Portföy Dağılımı	
Ters Repo	99,36%
Takasbank Para Piyasası İşlemleri	0,64%
Toplam	100,00%

Fon'un Yatırım Amacı	Portföy Yöneticileri
Fon portföyüne dahil edilen varlıklar kısa vadeli kamu ve özel sektör bonoları ve para piyasası enstrümanlarından seçilerek yatırımcısına düzenli getiri imkanı ve günlük nakde dönüşüm opsiyonunu sağlamayı hedeflerken fon stratejisi çok düşük risk düzeyinde yönetimi esas almaktadır. Fon portföyünde ayrıca mevduat ve katılma hesaplarına da yatırım yapılarak fon portföyü adına en yüksek iç verim hedeflenmiştir.	Ali Emrah Yücel
	Tevfik Eraslan
	Mehmet Sinan Veziroğlu
	Selin Yıldırım
	Didem Maden
En Az Alınabilir Pay Adedi : 50.000 Adet	

Yatırım Stratejisi
Fon portföyünün tamamı devamlı olarak, vadesine en fazla 184 gün kalmış, likiditesi yüksek para ve sermaye piyasası araçlarından oluşacak ve portföyünün günlük olarak hesaplanan ağırlıklı ortalama vadesi en fazla 45 gün olacaktır. Fon portföyüne dahil edilen varlıklar kısa vadeli, Rehber' de yer alan vade tanımına göre azami 184 günlük vadeye sahip kamu ve/veya özel sektör borçlanma araçları ve para piyasası enstrümanlarından seçilir. Fon, yatırımcısına düzenli getiri imkanı ve günlük nakde dönüşüm olanağı sağlamayı hedeflerken fon stratejisi düşük risk düzeyinde yönetimi esas almaktadır. Fon portföyüne vadesi hesaplanamayan varlıklar dahil edilmez. Para piyasası fonlarının fon toplam değerinin azami %50' si mevduat/katılma hesaplarında değerlendirilebilir. Ancak tek bir bankada değerlendirilebilecek tutar fon toplam değerinin %6' sını aşamaz.

Yatırım Riskleri
1) Piyasa Riski: Piyasa riski ile borçlanmayı temsil eden finansal araçların, diğer menkul kıymetlerin ile türev sözleşmelere ilişkin taşınan pozisyonların değerinde ve faiz oranlarındaki dalgalanmalar nedeniyle meydana gelebilecek zarar riski ifade edilmektedir. Söz konusu risklerin detaylarına aşağıda yer verilmektedir: a- Faiz Oranı Riski: Fon portföyüne faize dayalı varlıkların (borçlanma aracı, ters repo vb) dahil edilmesi halinde, söz konusu varlıkların değerinde piyasalarda yaşanabilecek faiz oranları değişimleri nedeniyle oluşan riski ifade eder. b- Kâr Payı Oranı Riski: Fon portföyüne kira sertifikası, katılma hesabı gibi kâra katılım olanağı sağlayan katılım finans ürünlerinin dahil edilmesi durumunda, söz konusu yatırımların getiri oranındaki değişimler nedeniyle maruz kalınabilecek zarar olasılığıdır.2) Karşı Taraf Riski: Karşı tarafın sözleşmeden kaynaklanan yükümlülüklerini yerine getirmek istememesi ve/veya yerine getirememesi veya takas işlemlerinde ortaya çıkan aksaklıklar sonucunda ödemenin yapılamaması riskini ifade etmektedir. 3) Likidite Riski: Fon portföyünde bulunan finansal varlıkların istenildiği anda piyasa fiyatından nakde dönüştürülebilmesi halinde ortaya çıkan zarar olasılığıdır.4) Etik Risk: Dolandırıcılık, suistimal, zimmete para geçirme, hırsızlık gibi nedenler ile Fon'u zarara uğratabilecek kasıtlı eylemler ya da Fon'un itibarını olumsuz etkileyecek suçların (örneğin, kara para aklanması) işlenmesi riskidir.5) Operasyonel Risk: Operasyonel risk, fonun operasyonel süreçlerindeki aksamalar sonucunda zarar oluşması olasılığını ifade eder. Operasyonel riskin kaynakları arasında kullanılan sistemlerin yetersizliği, başarısız yönetim, personelin hatalı ya da hileli işlemleri gibi kurum içi etkenlerin yanı sıra doğal afetler, rekabet koşulları, politik rejim değişikliği gibi kurum dışı etkenler de olabilir.6) Yoğunlaşma Riski: Belli bir varlığa ve/veya vadeye yoğun yatırım yapılması sonucu fonun bu varlığın ve vadenin içerdiği risklere maruz kalmasıdır.7) Korelasyon Riski: Farklı finansal varlıkların piyasa koşulları altında belirli bir zaman dilimi içerisinde aynı anda değer kazanması ya da kaybetmesine paralel olarak, en az iki farklı finansal varlığın birbirleri ile olan pozitif veya negatif yönlü ilişkileri nedeniyle doğabilecek zarar ihtimalini ifade eder.8) Yasal Risk: Fonun halka arz edildiği dönemden sonra mevzuatta ve düzenleyici otoritelerin düzenlemelerinde meydana gelebilecek değişikliklerden olumsuz etkilenmesi riskidir.9) İhraççı Riski: Fon portföyüne alınan varlıkların ihraççısının yükümlülüklerini kısmen veya tamamen zamanında yerine getirememesi nedeniyle doğabilecek zarar ihtimalini ifade eder.10) Yapılandırılmış Yatırım Aracı Riski: Yapılandırılmış yatırım araçlarına yapılan yatırımla yatırımcıların anaparasının %100'ünün yatırım dönemi sonunda geri ödenmesi amaçlanmaktadır. Yapılandırılmış yatırım araçlarının dayanak varlıkları üzerine oluşturulan stratejilerin getirisinin ilgili dönemde negatif olması halinde yatırımcı vade sonunda dayanak varlık üzerine oluşturulan stratejilerden sadece % 100'lük anapara koruma hedefi sağlayacak olup, dayanak varlık üzerine oluşturulan stratejilerden elde edilecek ekstra getiriden yararlanamama riski ile karşı karşıya kalabilmektedir.11) Kaldıraç Yaratan İşlem Riski: Fon portföyüne türev araç (vadeli işlem sözleşmeleri), saklı türev araç ile ileri valörlü borçlanma araçları işlemlerinde ve diğer herhangi bir yöntemle kaldıraç yaratan benzeri işlemlerde bulunulması halinde, başlangıç yatırımı ile başlangıç yatırımının üzerinde pozisyon alınması sebebi ile fonun başlangıç yatırımından daha yüksek zarar kaydedebilme olasılığı kaldıraç riskini ifade eder.

## B. PERFORMANS BİLGİSİ

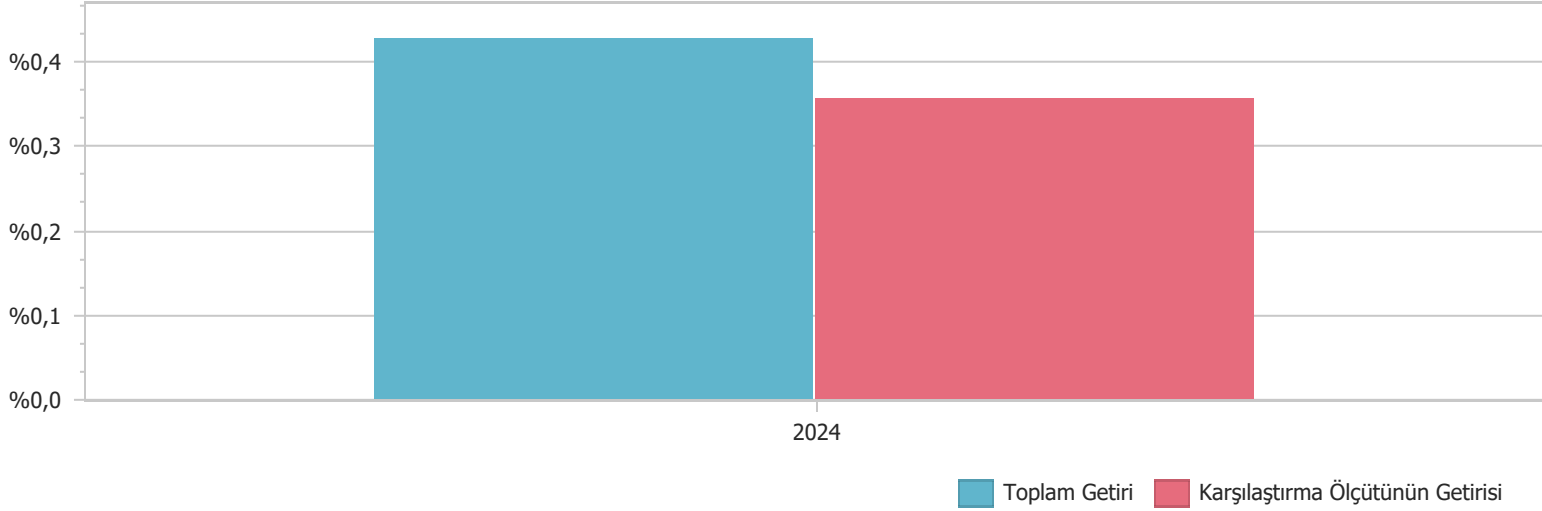
PERFORMANS BİLGİSİ							
YILLAR	Toplam Getiri (%)	Karşılaştırma Ölçütünün Getirisi (%)	Enflasyon Oranı (%) (TÜFE) (*)	Portföyün Zaman İçinde Standart Sapması (%) (**)	Karşılaştırma Ölçütünün Standart Sapması (%) (**)	Bilgi Rasyosu	Sunuma Dahil Dönem Sonu Portföyün Toplam Değeri / Net Aktif Değeri
2024 (***)	0,429%	0,357%	0,163%	-	-	-	13.141.651,69

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

(\*\*) Portföyün ve karşılaştırma ölçütünün standart sapması dönemdeki günlük getiriler üzerinden hesaplanmıştır.

(\*\*\*) İlgili veriler 27.06.2024 tarihinden rapor tarihine kadar olan değerleri vermektedir.

### PERFORMANS GRAFİĞİ



**GEÇMİŞ GETİRİLER GELECEK DÖNEM PERFORMANSI İÇİN BİR GÖSTERGE SAYILMAZ.**

### C. DİPNOTLAR

1) Rota Portföy Yönetimi A.Ş.'nin ana faaliyet konusu, SPKn ve ilgili mevzuat hükümleri çerçevesinde yatırım fonlarının kurulması ve yönetimidir. Ayrıca, yatırım ortaklıklarının, 28/3/2001 tarihli ve 4632 sayılı Bireysel Emeklilik Tasarruf ve Yatırım Sistemi Kanunu kapsamında kurulan emeklilik yatırım fonlarının ve bunların muadili yurt dışında kurulmuş yabancı kolektif yatırım kuruluşlarının portföylerinin yönetimi de ana faaliyet konusu kapsamındadır. Şirket, sermaye piyasası mevzuatında yer alan şartları sağlamak ve Sermaye Piyasası Kurulundan ("Kurul") gerekli izin ve/veya yetki belgelerini almak kaydıyla portföy yöneticiliği, yatırım danışmanlığı ve kurucusu olduğu yatırım fonlarının katılma payları dahil olmak üzere fon katılma payları ile değişken sermayeli yatırım ortaklıklarının paylarının pazarlanması ve dağıtılması faaliyetinde bulunabilir.

2) Fon Portföyü'nün yatırım amacı, yatırımcı riskleri ve stratejisi "Tanıtıcı Bilgiler" bölümünde belirtilmiştir.

3) Fon 27.06.2024 - 28.06.2024 döneminde net %0,43 oranında getiri sağlarken, karşılaştırma ölçütünün getirisi aynı dönemde %0,36 olmuştur. Sonuç olarak Fon'un nispi getirisi %0,07 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.

27.06.2024 - 28.06.2024 döneminde :	Portföy Değerine Oranı (%)	TL Tutar
Fon Yönetim Ücreti	0,002589%	340,29
Denetim Ücreti Giderleri	0,000000%	0,00
Saklama Ücreti Giderleri	0,000493%	64,80
Aracılık Komisyonu Giderleri	0,002181%	286,65
Kurul Kayıt Ücreti	0,000000%	0,00
Diğer Faaliyet Giderleri	0,000000%	0,00
Toplam Faaliyet Giderleri	691,74	
Ortalama Fon Toplam Değeri	6.570.825,85	
Toplam Faaliyet Giderleri / Ortalama Fon Toplam Değeri	0,010527%	

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

Kıstas Dönemi	Kıstas Bilgisi
27.06.2024-...	%20 BIST-KYD DİBS 91 Gün + %40 BIST-KYD Repo (Brüt) + %20 BIST-KYD ÖSBA Değişken + %20 BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Mevduat TL

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

## D. İLAVE BİLGİLER VE AÇIKLAMALAR

### 1) Getiri Oranını Etkileyen Piyasa Koşulları

27.06.2024 - 28.06.2024 Dönem Getirisi	Getiri
BIST 100 ENDEKSİ	-0,31%
BIST 30 ENDEKSİ	-0,77%
BIST-KYD REPO BRÜT ENDEKSİ	0,43%
BIST-KYD DİBS 91 GÜN ENDEKSİ	0,33%
BIST-KYD DİBS 182 GÜN ENDEKSİ	-0,04%
BIST-KYD DİBS 365 GÜN ENDEKSİ	0,27%
BIST-KYD DİBS 547 GÜN ENDEKSİ	0,24%
BIST-KYD DİBS TÜM ENDEKSİ	0,23%
BIST-KYD DİBS UZUN ENDEKSİ	0,33%
BIST-KYD ÖSBA SABİT ENDEKSİ	0,13%
BIST-KYD ÖSBA DEĞİŞKEN ENDEKSİ	0,14%
BIST-KYD Kamu Kira Sertifikaları Endeksi	0,07%
BIST-KYD Özel Sektör Kira Sertifikaları Endeksi	0,12%
BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Mevduat Endeksi (TL)	0,45%
BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Kar Payı TL Endeksi	0,28%
BIST Katılım 50 GETİRİ ENDEKSİ	-0,74%
BIST-KYD ALTIN FİYAT AĞIRLIKLILIKLI ORTALAMA	0,99%
BIST-KYD Eurobond USD (TL)	0,01%
BIST-KYD Eurobond EUR (TL)	0,05%
Dolar Kuru	-0,05%
Euro Kuru	0,02%

	CFO
Net Basit Getiri	0,43%
Gerçekleşen Fon Toplam Giderleri Oranı	0,01%
Azami Toplam Gider Oranı	1,65%
Kurucu Tarafından Karşılanaan Giderlerin Oranı	0,00%
Net Gider Oranı	0,01%
Brüt Getiri	0,44%