

LOGOS-DD

LOGOS PORTFÖY DİNAMİK DAĞILIMLI SERBEST FON

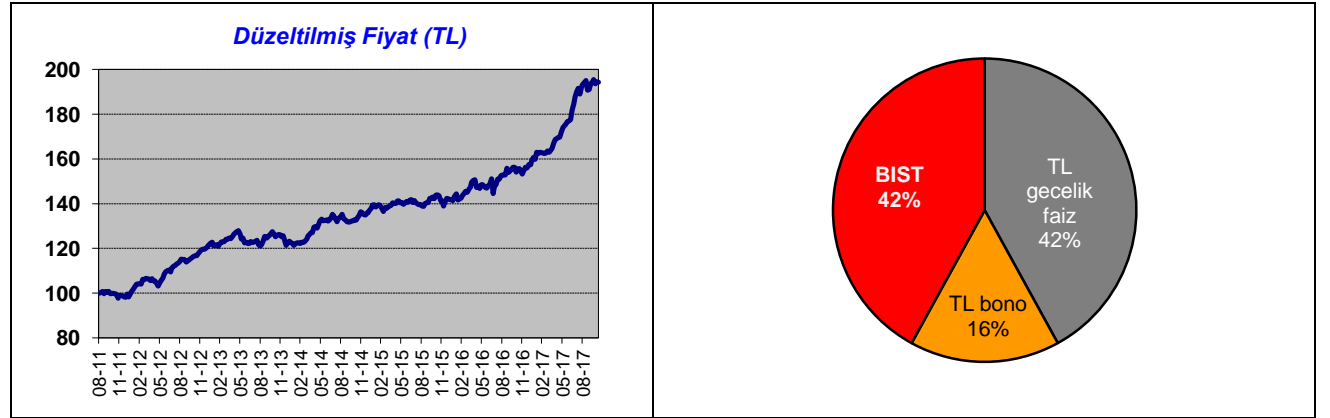
12 Kasım 2017

Fon Stratejisi ve Profili

Fon, Türk sermaye piyasaları odaklı olup, BİST hisse senetleri, sabit getirili ve türev enstrümanlardan yararlanarak piyasanın dalgalanmalarından kısmen bağımsız mutlak getiri hedeflemektedir. Bu amaca yönelik olarak politik / makroekonomik analize dayalı piyasa zamanlaması ile varlık sınıfı dağılımının “dinamik” olarak ayarlanması; ayrıca temel analize dayalı hisse senedi seçimi yoluyla “alfa” (yani piyasadan bağımsız pozitif getiri) elde edilmesi hedeflenmektedir. Kayıpları sınırlamak içinse “stop loss” ve “portföy sigortası” gibi metodlar kullanılır. Genellikle “hedge” amacı dışında kaldıraç kullanılmaz.

Fon Kurucusu	Logos Portföy Yönetimi A.Ş.		
Portföy Yöneticisi	Logos Portföy Yönetimi A.Ş.		
Saklayıcı Kuruluş	T. İş Bankası A.Ş.		
Fon Hizmet Birimi	İş Yatırım Menkul Değerler A.Ş.		
Giriş ve Çıkışlar	Haftalık		
Yönetim Komisyonu	%1.0		
Başarı Primi	Kıstasın üzerindeki getiriden %20 (Yüksek Su İzi Mevcut)		
Kıstas	KYD brüt repo endeksi		
Halka Arz Tarihi	29/8/2011		
Son Haftanın Getirisi	-0.04%	Yıllık Volatilité: Fon	6.1%
Cari Yıl: 2017 Getirisi	23.36%	Yıllık Volatilité: BIST-100	20.7%
2017 Yıllıklandırılmış	27.34%	Sharpe rasyosu	0.73
Arzdan Beri Yıllık Ortalama Getiri	11.30%	Beta (BIST-100)	0.24

Halka Arzdan Bugüne Düzeltilmiş Fiyat* ve Performans



*Halka arzdan önceki “backtesting” dönemindeki fiyatlar, performansı tam olarak yansıtmadığından, halka arz tarihindeki fiyatı 100 olarak alan düzeltilmiş fiyatlar gösterilmiştir.

	Oca	Şub	Mar	Nis	May	Haz	Tem	Ağs	Eyl	Eki	Kas	Ara	Küm.
‘11								100.00	100.70	99.87	98.85	98.11	(1.99%)
									0.70%	-0.83%	-1.01%	-0.75%	
‘12	101.43	104.17	106.61	105.88	104.12	109.63	111.60	114.25	113.88	116.38	118.44	120.35	22.67%
	3.39%	2.70%	2.34%	-0.68%	-1.54%	5.16%	1.80%	2.38%	-0.32%	2.19%	1.78%	1.61%	
‘13	121.23	121.85	124.11	125.62	126.53	122.75	122.81	121.00	124.69	126.70	126.13	122.31	1.63%
	0.74%	0.51%	1.86%	1.21%	0.73%	-2.99%	0.05%	-1.47%	3.05%	1.61%	-0.44%	-3.03%	
‘14	121.36	122.26	124.19	128.89	132.30	132.76	134.14	133.88	131.60	132.75	136.35	136.13	11.30%
	-0.78%	0.74%	1.58%	3.79%	2.64%	0.35%	1.04%	-0.20%	-1.70%	0.87%	2.71%	-0.16%	
‘15	139.59	139.14	138.06	140.07	140.41	140.59	141.43	139.88	139.99	142.21	141.34	142.29	4.53%
	2.54%	-0.32%	-0.77%	1.46%	0.24%	0.13%	0.60%	-1.10%	0.08%	1.59%	-0.61%	0.67%	
‘16	143.18	142.99	146.44	150.66	148.49	147.85	147.82	152.43	154.02	156.45	154.08	157.54	10.71%
	0.62%	-0.14%	2.42%	2.88%	-1.44%	-0.43%	-0.02%	3.11%	1.04%	1.58%	-1.52%	2.24%	
‘17	161.45	161.54	163.00	168.65	172.67	177.07	187.96	193.25	191.09	193.63	194.34		23.36%
	2.49%	0.06%	0.91%	3.46%	2.39%	2.55%	6.15%	2.82%	-1.12%	1.33%	0.37%		

Telefon: (212) 215 6030

E-posta: info@logosportfoy.com

Faks: (212) 215 5129

www.logosportfoy.com

Bu rapor yalnızca bilgi amaçlı olarak hazırlanmıştır. Raporun içeriğinin doğruluğundan Logos Portföy Yönetimi A.Ş. sorumlu tutulamaz. Yatırımcıların, raporun içeriğinin doğruluğunu kendileri teyit etmeleri ve yatırım kararlarını buna göre almaları gerekir.