

**ALLBATROSS PORTFÖY BİANCO SERBEST (TL) FON**

30 HAZİRAN 2024 TARİHİ İTİBARIYLA YATIRIM

PERFORMANSI KONUSUNDA

KAMUYA AÇIKLANAN BİLGİLERE İLİŞKİN RAPOR

## ALLBATROSS PORTFÖY BIANCO SERBEST (TL) FON

### Yatırım Performansı Konusunda Kamuya Açıklanan Bilgilere İlişkin Rapor

Allbatross Portföy Bianco Serbest (TL) Fon 01 Ocak – 30 Haziran 2024 dönemine ait ekteki performans sunuş raporunu Sermaye Piyasası Kurulu'nun VII-128.5 sayılı bireysel Portföylerin ve Kolektif Yatırım Kuruluşların Performans sunumuna, Performansa Dayalı Ücretlendirmesine Kolektif Yatırım Kuruluşlarını Notlandırma ve Sıralama Faaliyetlerine İlişkin Esaslar Hakkında Tebliğ'inde ("Tebliğ") yer alan performans sunum standartlarına ilişkin düzenlemeleri çerçevesinde incelemiş bulunuyoruz.

İncelememiz sadece yukarıda belirtilen döneme ait performans sunumunu kapsamaktadır. Bunun dışında kalan dönemler için inceleme yapılmamış ve görüş oluşturulmamıştır.

İncelememiz sonucunda Fon'un 01 Ocak – 30 Haziran 2024 dönemine ait performans sunum raporunun Tebliğ'de belirtilen performans sunum standartlarına ilişkin düzenlemelere uygun hazırlanmadığı ile doğru ve gerçeğe uygun bir görünüm sağlamadığı kanaatine varmamıza sebep olacak herhangi bir tespitimiz bulunmamaktadır.

#### Diğer Husus

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

NEVADOS BAĞIMSIZ DENETİM A.Ş.



Halil Sağlam, SMMM

Sorumlu Denetçi

İstanbul, 31 Temmuz 2024



## ALLBATROSS PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş. TARAFINDAN KURULAN VE YÖNETİLEN

## ALLBATROSS PORTFÖY BIANCO SERBEST (TL) FON

01 OCAK 2024 - 30 HAZİRAN 2024 DÖNEMİNE AİT

## PERFORMANS SUNUM RAPORU

## A. TANITICI BİLGİLER

PORTFÖYE BAKIŞ Halka Arz Tarihi: 18/11/2022		YATIRIM VE YÖNETİME İLİŞKİN BİLGİLER	
30 Haziran 2024 tarihi itibarıyla		Fonun Yatırım Amacı	Portföy Yöneticileri
Fon Toplam Değeri	157.205.170	Fon yatırım öngörüsü doğrultusunda sermaye piyasası araçlarına, Kurulca uygun görülen diğer yatırım araçlarına, taraf olunacak sözleşmelere, finansal işlemlere ve menkul kıymetlere yatırım yaparak sermaye kazancı sağlamak portföy değerini artırmayı amaçlamaktadır.	İbrahim Başügüdücü
Birim Pay Değeri	1,259444		Altuğ Dayıoğlu
Yatırımcı Sayısı	12		Ünlü Emre Coşkun
Tedavül Oranı %	36,71%		Oğuzhan Özer
			Mustafa Başalp
			Filiz Özcan
			Hüseyin Sert
			Orçun Berkay Kaya
			İlayda Akalan
			En Az Alınabilir Pay Adedi: 1 Adet
Portföy Dağılımı %		Yatırım Stratejisi	
Ortaklık Payları	95,07%	Fon portföyünün yönetiminde ve yatırım yapılacak sermaye piyasası araçlarının seçiminde, Tebliğ'in 4. maddesinde belirtilen varlık ve işlemlerin, yabancı para birimi cinsinden varlık ve altın ile diğer kıymetli madenler ve bunlara dayalı sermaye piyasası araçları dışındakiler ile 6. maddesinde fon türlerinden serbest şemsiye fon niteliğine uygun bir portföy oluşturulması esas alınır. Fon, Tebliğ'in 25. maddesinde yer alan serbest fonlara dair esaslara uyulur. Fon portföyünde yalnızca Türk lirası cinsinden varlıklar ve işlemler yer alacaktır.	
- Turizm	80,26%		
- İnşaat Malzemeleri	4,01%		
- Perakende	2,42%		
- Elektrik	1,59%		
- Holding	1,17%		
- Çimento	0,89%		
- Petrol Ve Petrol Ürünleri	0,73%		
- Elektrik Makinaları Üretimi	0,73%		
- Cam	0,66%		
- İletişim Cihazları	0,64%	Yatırım Riskleri	
- Gayrimenkul Yatırım Ort.	0,56%	Yatırımcılar fona yatırım yapmadan önce fon ile ilgili temel yatırım risklerini değerlendirmelidir. Fonun maruz kalabileceği temel risklerden kaynaklanabilecek değişimler sonucunda olası düşüslere bağlı olarak yatırımlarının değerinin başlangıç değerinin altına düşebileceğini göz önünde bulundurulmalıdır. Fon'un maruz kalabileceği riskler: Piyasa Riski (Faiz Oranı Riski , Ortaklık Payı Fiyat Riski, Kar Payı Oranı Riski), Karşı Taraf Riski, Likidite Riski, Kaldıraç Yaratan İşlem Riski, Operasyonel Risk, Yoğunlaşma Riski, Korelasyon Riski, Yasal Risk, İhraççı Riski, Açığa Satış Riski, Teminat Riski, Opsiyon Duyarlılık Riski, Yapılandırılmış Yatırım/ Borçlanma Araçları Riskleri, Baz Riski, Etik Risk , Salgın Hastalık Riski olup bu risklere ilişkin detaylı açıklamalar fon İzahnamesinin III. Bölümünde yer almaktadır. Fon'un yatırım stratejisi ile yatırım yapılan varlıkların yapısına ve risk düzeyine uygun bir risk yönetim sistemi oluşturulmuştur.	
- Teknoloji	0,47%		
- Hava Yolları Ve Hizmetleri	0,47%		
- Aracı Kurum	0,23%		
- Endüstriyel Tekstil	0,23%		
Yatırım Fonu Katılma Payları	4,93%		
Toplam	100,00%		

**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	4,598%	1,709%	2,340%	0,272%	0,0331%	0,3542	117.868.558,07
2023	-7,371%	28,334%	64,773%	2,477%	0,0726%	-0,0397	660.627,28
2024 (***)	29,624%	27,407%	24,735%	2,356%	0,1411%	0,0177	157.205.170,21

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

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

(\*\*\*) İlgili veriler 01.01.2024 tarihinden rapor tarihine kadar olan değerleri vermektedir.

**C. DİPNOTLAR**

1) Fon portföyü Allbatross Portföy Yönetimi A.Ş. tarafından yönetilmektedir. Allbatross Portföy Yönetimi A.Ş. Sermaye Piyasası Kanunu ve ilgili mevzuat hükümlerine uygun olarak müşterilerle portföy yöneticiliği sözleşmeleri yaparak sermaye piyasası araçlarından oluşan portföy yöneticiliği faaliyetlerinde bulunmak üzere 23/08/2018 tarihinde kurulmuş ve 16/03/2022 tarihinde Sermaye Piyasası Kurulu'nca portföy yöneticiliği faaliyet izni verilmiştir. Şirketimizin ana faaliyet konusu fon kurulumu, fon ve özel portföy yönetimidir.

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

3) Fon 01.01.2024 - 30.06.2024 döneminde net %29,62 oranında getiri sağlarken, karşılaştırma ölçütünün eşik değerinin getirisi aynı dönemde %27,41 olmuştur. Sonuç olarak Fon'un nispi getirisi %2,22 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 nispi 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.

01/01/2024 - 30/06/2024 döneminde	Portföy Değerine Oranı (%)	TL Tutar
Fon Yönetim Ücreti	0,005125%	815.376,74
Denetim Ücreti Giderleri	0,000112%	17.809,20
Saklama Ücreti Giderleri	0,000697%	110.869,83
Aracılık Komisyonu Giderleri	0,000456%	72.562,59
Kurul Kayıt Ücreti	0,000088%	14.051,50
Diğer Faaliyet Giderleri	0,000442%	70.299,35
Toplam Faaliyet Giderleri		1.100.969,21
Ortalama Fon Portföy Değeri		88.392.351,68
Toplam Faaliyet Giderleri / Ortalama Fon Portföy Değeri		1,245548%

5) Performans sunum dönemi içerisinde karşılaştırma ölçütü sabit kalmıştır.

Dönem	Karşılaştırma Ölçütü Bilgisi
18.11.2022-1.01.2023	%100 BIST-KYD 1 Aylık Mevduat (TL) Endeksi (17/11/2022)
02.01.2023-1.01.2024	%100 BIST-KYD 1 Aylık Mevduat (TL) Endeksi (30/12/2022)
02.01.2024-30.06.2024	%100 BIST-KYD 1 Aylık Mevduat (TL) Endeksi (29/12/2023)

#### 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
18.11.2022 - 30.12.2022	4,60%	4,66%	1,71%	2,89%
02.01.2023 - 29.12.2023	-7,37%	-6,86%	28,33%	-35,71%
02.01.2024 - 30.06.2024	29,62%	30,55%	27,41%	2,22%

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
18.11.2022 - 30.12.2022	0,02%	0,03%	0,11%	0,45%	0,06%	0,59%	0,20%	0,96%
02.01.2023 - 29.12.2023	0,18%	0,71%	0,20%	0,80%	0,21%	0,86%	0,16%	0,93%
02.01.2024 - 30.06.2024	0,09%	0,27%	0,06%	0,38%	0,08%	0,43%	-0,01%	0,50%

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

Dönemler	Takip Hatası	Beta
18.11.2022 - 30.12.2022	0,0447	2,1553
02.01.2023 - 29.12.2023	0,3929	2,2705
02.01.2024 - 30.06.2024	0,3729	1,3511

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

Yıllar	Portföy		Eşik Değeri	
	Getiri	Standart Sapma	Getiri	Standart Sapma
2022	4,60%	0,27%	1,71%	0,03%
2023	-7,37%	2,48%	28,33%	0,07%
2024	29,62%	2,36%	27,41%	0,14%

## 5) Yatırım Fonu Endeksleri Karşılaştırma Tablosu

Dönemler	Portföy	Yatırım Fonu Endeksleri
18.11.2022 - 30.12.2022	4,60%	18,59%
02.01.2023 - 29.12.2023	-7,37%	127,48%
02.01.2024 - 30.06.2024	29,62%	27,32%

## 6) Kredi Kullanım Bilgisi

Kredi Kullanılan Kurum	Kredi Tutarı	Kredi Para Birimi	Faiz Oranı (%)	Kullandırım Tarihi	Son Geri Ödeme Günü
Q Yatırım Bankası A.Ş.	10.000.000	TL	% 67	25.04.2024	24.04.2025

\* Kullanılan kredi rotatif olup, günlük faiz ödemelidir.

## 7) Getiri Oranını Etkileyen Piyasa Koşulları

29.12.2023 - 30.06.2024 Dönem Getirisi	Getiri
BIST 100 ENDEKSİ	45,05%
BIST 30 ENDEKSİ	46,99%
BIST-KYD REPO BRÜT ENDEKSİ	27,08%
BIST-KYD DİBS 91 GÜN ENDEKSİ	18,27%
BIST-KYD DİBS 182 GÜN ENDEKSİ	18,74%
BIST-KYD DİBS 365 GÜN ENDEKSİ	17,10%
BIST-KYD DİBS 547 GÜN ENDEKSİ	14,26%
BIST-KYD DİBS TÜM ENDEKSİ	6,87%
BIST-KYD DİBS UZUN ENDEKSİ	3,82%
BIST-KYD ÖSBA SABİT ENDEKSİ	22,89%
BIST-KYD ÖSBA DEĞİŞKEN ENDEKSİ	27,64%
BIST-KYD Kamu Kira Sertifikaları Endeksi	12,26%
BIST-KYD Özel Sektör Kira Sertifikaları Endeksi	21,52%
BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Mevduat Endeksi (TL)	27,41%
BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Kar Payı TL Endeksi	17,18%
BIST Katılım 50 GETİRİ ENDEKSİ	33,81%
BIST-KYD ALTIN FİYAT AĞIRLIKLIL ORTALAMA	25,05%
BIST-KYD Eurobond USD (TL)	14,38%
BIST-KYD Eurobond EUR (TL)	10,53%
Dolar Kuru	11,51%
Euro Kuru	7,84%

	BBI
Net Basit Getiri	29,62%
Gerçekleşen Fon Toplam Giderleri Oranı	1,25%
Azami Toplam Gider Oranı	-
Kurucu Tarafından Karşılanan Giderlerin Oranı	0,00%
Net Gider Oranı	1,25%
Brüt Getiri	30,87%