

ALLBATROSS PORTFÖY DEFNE SERBEST FON
30 HAZİRAN 2024 TARİHİ İTİBARIYLA YATIRIM
PERFORMANSI KONUSUNDA
KAMUYA AÇIKLANAN BİLGİLERE İLİŞKİN RAPOR

ALLBATROSS PORTFÖY DEFNE SERBEST FON

Yatırım Performansı Konusunda Kamuya Açıklanan Bilgilere İlişkin Rapor

Allbatross Portföy Defne Serbest 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 DEFNE SERBEST FON

01 OCAK 2024 - 30 HAZİRAN 2024 DÖNEMİNE AİT

PERFORMANS SUNUM RAPORU

A. TANITICI BİLGİLER

PORTFÖYE BAKIŞ Haika Arz Tarihi: 10/10/2023		YATIRIM VE YÖNETİME İLİŞKİN BİLGİLER	
30 Haziran 2024 tarihi itibarıyla		Fonun Yatırım Amacı	Portföy Yöneticileri
Fon Toplam Değeri	90.267.313,60	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	1,578712		Altuğ Dayıoğlu
Yatırımcı Sayısı	235		Ünlü Emre Coşkun
Tedavül Oranı %	11,44%		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	56,63%	Temel yatırım stratejisi olarak Fon, portföy yöneticisinin yerel ve global piyasalardaki trendleri yakından takip ederek, makroekonomik faktörlerin analizi ve piyasa öngörüsü doğrultusunda seçeceği bir veya birden fazla temaya dayalı yerli/yabancı ortaklık paylarına, borsa yatırım fonlarına ve diğer sermaye piyasası araçlarına yatırım yaparak, orta ve uzun vadede TL bazında yüksek getiri sağlamayı amaçlamaktadır. Ana strateji, belirlenen temalara portföy zamanlamasını efektif olarak kullanarak orta-uzun vadeli yatırım yapılması yönündedir. Fon, portföy dağılımının değişen piyasa koşullarına göre dinamik olarak değiştirilmesi suretiyle sermaye kazancı elde etmeyi hedeflemektedir.	
- Perakende	8,19%		
- Otomotiv	7,70%		
- Gıda	7,11%		
- Biracılık Ve Meşrubat	6,94%		
- Çimento	6,10%		
- Holding	5,78%		
- Sağlık	5,36%		
- Elektrik	4,84%		
- İnşaat, Taahhüt	2,52%		
- Petrol Ve Petrol Ürünleri	1,11%		
- Seramik	0,99%		
Yatırım Fonu Katılma Payları	41,55%		
Teminat	1,82%		
Toplam	100,00%		
		Yatırım Riskleri	
		Yatırımcılar fona yatırım yapmadan önce fon ile ilgili temel yatırım risklerini değerlendirmelidir. Fonun maruz kalabileceği temel risklerden kaynaklanabilecek değişimler sonucunda olası düşüşlere bağlı olarak yatırımlarının değerinin başlangıç değerinin altına düşebileceğini göz önünde bulundurmalıdır. Fon'un maruz kalabileceği riskler: Piyasa Riski (Faiz oranı riski , Ortaklık Payı Fiyat Riski, Kur riski, Kıymetli Madenler Riski, Emtiaya Dayalı Türev Araçlar Riski, Kar Payı Oranı Riski ve Kira Sertifikası Fiyat Riski), Karşı Taraf Riski, Likidite Riski, Kaldıraç Yaratıcı İşlem Riski, Operasyonel Risk, Yoğunlaşma Riski, Korelasyon Riski, Yasal Risk, İhraççı Riski, Açığa Satış Riski, Teminat Riski, Baz Riski, Etik Risk , Opsiyon duyarlılık riskleri, Yapılandırılmış yatırım/borçlanma araçları riski olup bu risklere ilişkin detaylı açıklamalar fon KAP sayfasının "Risk Ölçüm-Değerleme Esasları" Bölümünde yer almaktadır. Fon'un yatırım stratejisi ile yatırım yapılan varlıkların yapısına ve risk düzeyine uygun bir risk yönetim sistemi oluşturulmuştur.	

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
2023	1,234%	8,692%	8,764%	1,375%	0,0942%	-0,0829	8.585.162,97
2024 (***)	55,957%	27,081%	24,735%	0,908%	0,1348%	0,1894	90.267.313,60

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

(**) Portföyün ve karşılaştırma ölçütünün 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 %55,96 oranında getiri sağlarken, eşik değerinin getirisi aynı dönemde %27,08 olmuştur. Sonuç olarak Fon'un nispi getirisi %28,88 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 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	0,006214%	305.987,04
Denetim Ücreti Giderleri	0,000353%	17.368,20
Saklama Ücreti Giderleri	0,002901%	142.860,31
Aracılık Komisyonu Giderleri	0,002904%	143.008,62
Kurul Kayıt Ücreti	0,000112%	5.501,04
Diğer Faaliyet Giderleri	0,001134%	55.823,88
Toplam Faaliyet Giderleri		670.549,09
Ortalama Fon Portföy Değeri		27.356.675,97
Toplam Faaliyet Giderleri / Ortalama Fon Portföy Değeri		2,451135%

5) Performans sunum dönemi içerisinde karşılaştırma ölçütü sabit kalmıştır.

Dönem	Karşılaştırma Ölçütü Bilgisi
10.10.2023-1.01.2024	%100 BIST-KYD Repo (Brüt) Endeksi(09/10/2023)
2.01.2024-30.06.2024	%100 BIST-KYD Repo (Brüt) 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
10.10.2023 - 29.12.2023	1,23%	1,71%	8,69%	-7,46%
2.01.2024 - 30.06.2024	55,96%	57,60%	27,08%	28,88%

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
10.10.2023-29.12.2023	0,11%	0,09%	0,19%	0,46%	0,18%	0,51%	0,20%	0,64%
2.01.2024 - 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
10.10.2023 - 29.12.2023	0,2178	1,7118
2.01.2024 - 30.06.2024	0,1482	0,0679

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
2023	1,23%	1,38%	8,69%	0,09%
2024	55,96%	0,91%	27,08%	0,13%

5) Yatırım Fonu Endeksleri Karşılaştırma Tablosu

Dönemler	Portföy	Yatırım Fonu Endeksleri
10.10.2023 - 29.12.2023	1,23%	19,45%
2.01.2024 - 30.06.2024	55,96%	27,32%

6) 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%

	DEF
Net Basit Getiri	55,96%
Gerçekleşen Fon Toplam Giderleri Oranı	2,45%
Azami Toplam Gider Oranı	-
Kurucu Tarafından Karşılanan Giderlerin Oranı	0,00%
Net Gider Oranı	2,45%
Brüt Getiri	58,41%