

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

ALLBATROSS PORTFÖY ESİN SERBEST FON

Yatırım Performansı Konusunda Kamuya Açıklanan Bilgilere İlişkin Rapor

Allbatross Portföy Esin 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 ESİN SERBEST FON

01 OCAK 2024 - 30 HAZİRAN 2024 DÖNEMİNE AİT

PERFORMANS SUNUM RAPORU

A. TANITICI BİLGİLER

PORTFÖYE BAKIŞ Halka Arz Tarihi: 4/04/2024		YATIRIM VE YÖNETİME İLİŞKİN BİLGİLER	
30 Haziran 2024 tarihi itibarıyla		Fonun Yatırım Amacı	Portföy Yöneticileri
Fon Toplam Değeri	96.608.021,04	Portföy yöneticisi; global ve yerel konjonktürü analiz ederek ve değişken stratejiye ve ortaklık paylarına dayalı türev kontratlara, dövizde dayalı enstrümanlara dinamik olarak yatırım yaparak, Türk Lirası cinsinden reel getiri sağlamayı amaçlamaktadır.	İbrahim Başüğüdücü
Birim Pay Değeri	1,088597		Altuğ Dayıoğlu
Yatırımcı Sayısı	7		Ünlü Emre Coşkun
Tedavül Oranı %	17,75%		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	54,25%	Fon'un ana yatırım stratejisi, global ölçekte her türlü menkul kıymete ve menkul kıymete dayalı enstrümanlara aktif olarak yatırım yapmak suretiyle, değişken ve esnek bir fon kompozisyonu oluşturmaktır. Fon portföy değerinin sürekli olarak en az %51'i BIST'te işlem gören ortaklık paylarından oluşacaktır. Portföy yöneticisi, piyasa öngörüsüne bağlı olarak, %51'lik kısım dışındaki varlıkların getiri potansiyellerine göre fon portföyündeki ağırlıklarını dinamik bir şekilde değiştirir. Fon portföyüne sabit getirili menkul kıymet ve/veya faize dayalı enstrümanlar da dahil edilebilir.	
- Deri Giyim	17,49%		
- Hava Yolları ve Hizmetleri	7,37%		
- Holding	6,01%		
- Petrol ve Petrol Ürünleri	5,01%		
- Otomotiv	4,88%		
- Demir, Çelik Temel	4,24%		
- Tekstil, Entegre	2,96%		
- Cam	2,60%		
- Dayanıklı Tüketim	1,98%		
- Biracılık ve Meşrubat	1,71%		
Yatırım Fonu Katılma Payları	43,57%		
Teminat	2,18%		
Toplam	100%		
		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 İzahnamesinin III. 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
2024 (***)	9,064%	15,251%	7,953%	1,145%	0,7357%	-0,1285	96.608.021,04

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

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

(***) İlgili veriler 04.04.2024 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 %9,06 oranında getiri sağlarken, karşılaştırma ölçütünün getirisi aynı dönemde %15,25 olmuştur. Sonuç olarak Fon'un nispi getirisi %-6,19 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 ağırlıklandırılarak 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	0,000683%	48.941,65
Denetim Ücreti Giderleri	0,000242%	17.368,20
Saklama Ücreti Giderleri	0,000043%	3.071,58
Aracılık Komisyonu Giderleri	0,000846%	60.673,77
Kurul Kayıt Ücreti	0,000065%	4.671,16
Diğer Faaliyet Giderleri	0,000694%	49.776,49
Toplam Faaliyet Giderleri		184.502,85
Ortalama Fon Portföy Değeri		83.362.234,445
Toplam Faaliyet Giderleri / Ortalama Fon Portföy Değeri		0,221327%

5) Performans sunum dönemi içerisinde karşılaştırma ölçütü sabit kalmıştır.

Dönem	Karşılaştırma Ölçütü Bilgisi
4.04.2024-30.06.2024	%49 BIST-KYD Repo (Brüt) + %51 BIST 100 GETİRİ

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
4.04.2024 - 30.06.2024	9,06%	9,13%	15,25%	-6,19%

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
4.04.2024 - 30.06.2024	0,05%	0,29%	0,04%	0,31%	0,06%	0,31%	-0,06%	0,47%

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

Dönemler	Takip Hatası	Beta
4.04.2024 - 30.06.2024	0,1277	1,1236

4) Performans bilgisi tablosunda rapor dönemi portföy ve karşılaştırma ölçütü / eşik değeri standart sapmasına yer verilmiştir.

Yıllar	Portföy		Eşik Değeri	
	Getiri	Standart Sapma	Getiri	Standart Sapma
2024	9,06%	1,15%	15,25%	0,74%

*(Günlük verilerden hareketle hesaplanmıştır)

5) Yatırım Fonu Endeksleri Karşılaştırma Tablosu

Dönemler	Portföy	Yatırım Fonu Endeksleri
4.04.2024 - 30.06.2024	9,06%	11,51%

6) Getiri Oranını Etkileyen Piyasa Koşulları

29.12.2023 - 30.06.2024 Dönem Getirisi	Getiri
BIST 100 ENDEKSİ	17,47%
BIST 30 ENDEKSİ	17,15%
BIST-KYD REPO BRÜT ENDEKSİ	12,94%
BIST-KYD DİBS 91 GÜN ENDEKSİ	10,99%
BIST-KYD DİBS 182 GÜN ENDEKSİ	11,77%
BIST-KYD DİBS 365 GÜN ENDEKSİ	11,15%
BIST-KYD DİBS 547 GÜN ENDEKSİ	11,52%
BIST-KYD DİBS TÜM ENDEKSİ	5,17%
BIST-KYD DİBS UZUN ENDEKSİ	1,16%
BIST-KYD ÖSBA SABİT ENDEKSİ	10,55%
BIST-KYD ÖSBA DEĞİŞKEN ENDEKSİ	12,82%
BIST-KYD Kamu Kira Sertifikaları Endeksi	5,81%
BIST-KYD Özel Sektör Kira Sertifikaları Endeksi	10,03%
BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Mevduat Endeksi (TL)	13,77%
BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Kar Payı TL Endeksi	8,17%
BIST Katılım 50 GETİRİ ENDEKSİ	15,11%
BIST-KYD ALTIN FİYAT AĞIRLIKLİ ORTALAMA	3,36%
BIST-KYD Eurobond USD (TL)	4,73%
BIST-KYD Eurobond EUR (TL)	2,17%
Dolar Kuru	3,10%
Euro Kuru	1,64%

	ESN
Net Basit Getiri	9,06%
Gerçekleşen Fon Toplam Giderleri Oranı	0,22%
Azami Toplam Gider Oranı	-
Kurucu Tarafından Karşılanaan Giderlerin Oranı	0,00%
Net Gider Oranı	0,22%
Brüt Getiri	9,29%