

ALLBATROSS PORTFÖY KISA VADELİ SERBEST (TL) FON
30 HAZİRAN 2024 TARİHİ İTİBARIYLA YATIRIM
PERFORMANSI KONUSUNDA
KAMUYA AÇIKLANAN BİLGİLERE İLİŞKİN RAPOR

ALLBATROSS PORTFÖY KISA VADELİ SERBEST (TL) FON

Yatırım Performansı Konusunda Kamuya Açıklanan Bilgilere İlişkin Rapor

Allbatross Portföy Kısa Vadeli 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 KISA VADELİ SERBEST (TL) FON

01 OCAK 2024 - 30 HAZİRAN 2024 DÖNEMİNE AİT

PERFORMANS SUNUM RAPORU

A. TANITICI BİLGİLER

PORTFÖYE BAKIŞ Halka Arz Tarihi: 29/03/2023		YATIRIM VE YÖNETİME İLİŞKİN BİLGİLER	
30 Haziran 2023 tarihi itibarıyla		Fonun Yatırım Amacı	Portföy Yöneticileri
Fon Toplam Değeri	227.181.198,18	Fonun yatırım amacı, kısa vadeli TL sabit getirili menkul kıymetlere yatırım yaparak yatırımcısına düzenli getiri imkanı ve günlük nakde dönüşüm olanağı sağlamaktır.	İbrahim BAŞÜGÜDÜCÜ
Birim Pay Değeri	1,351244		Oğuzhan ÖZER
Yatırımcı Sayısı	36		Altuğ Dayıoğlu
Tedavül Oranı %	3,36%		Ünlü Emre Coşkun
		En Az Alınabilir Pay Adedi: 1 Adet	Mustafa Başalp
			Filiz Özcan
			Hüseyin Sert
			Orçun Berkay Kaya
			İlayda Akalan
Portföy Dağılımı %		Yatırım Stratejisi	
Borçlanma Araçları	93,42%	Fon'un yatırım stratejisi: Fon makroekonomik veriler, istatistiksel ve diğer analizlerle oluşacak piyasa beklentileri doğrultusunda sadece TL cinsi finansal varlıklara yatırım yaparak portföy değerini artırıp, Türk Lirası bazında mutlak getiri yaratmayı hedeflemektedir. Bu kapsamda, portföy yöneticileri global ekonomide yaşanan gelişmeleri ve varlık fiyatlarını analiz ederek alım satım kararları oluşturacaktır. Bu kararların oluşturulmasında global faizler, faiz farkları, dönemlik getiriler, varlık volatiliteleri ve korelasyon seviyeleri göz önünde bulundurulacaktır. Fon'un likidite açısından bir yönetim kısıtlaması yoktur. Fon portföyünün dağılımı belirlenirken, serbest fon niteliğine uygun şekilde bir veya birden fazla varlık sınıfına ağırlık verilebilecek, varlık dağılımı piyasa koşullarına göre esnek bir şekilde değiştirilebilecektir. Fon portföyünün tamamı devamlı olarak, likiditesi yüksek para ve sermaye piyasası araçlarından oluşacak ve fon portföyünün aylık ağırlıklı ortalama vadesi en az 25, en fazla 90gün olacaktır. Fon portföyüne vadeye kalan gün sayısı hesaplanamayan varlıklar dahil edilmez. Fon portföyüne sadece TL cinsi varlıklar ve işlemler dahil edilecektir.	
-Özel Sektör Borçlanma Araçları	93,42%		
Ters Repo	6,18%		
Takasbank Para Piyasası İşlemleri	0,40%		
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, Fon 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, Etik Risk, Baz Riski, Teminat Riski, Opsiyon Duyarlılık Riskleri, 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.			

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 (***)	6,398%	9,256%	4,840%	0,711%	1,0242%	-1,3503	227.181.198,18

(*) 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 02.05.2024 - 28.06.2024 döneminde net %6,40 oranında getiri sağlarken, karşılaştırma ölçütünün getirisi aynı dönemde %9,26 olmuştur. Sonuç olarak Fon'un nispi getirisi %-2,86 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.

02/05/2024 - 30/06/2024 döneminde	Portföy Değerine Oranı (%)	TL Tutar
Fon Yönetim Ücreti	0,014386%	2.400.592,05
Denetim Ücreti Giderleri	0,000106%	17.663,16
Saklama Ücreti Giderleri	0,002161%	360.610,55
Aracılık Komisyonu Giderleri	0,002087%	348.260,38
Tescil ve İlan Giderleri	0%	--
Kurul Kayıt Ücreti	0,000257%	42.888,42
Diğer Faaliyet Giderleri	0,000540%	90.163,14
Toplam Faaliyet Giderleri		3.260.177,7
Ortalama Fon Portföy Değeri		292.758.588,48
Toplam Faaliyet Giderleri / Ortalama Fon Portföy Değeri		1,113606%

5) SPK tebliğ gereği dönüşüm kapsamında strateji değişikliği 2.05.2024 tarihinde yapılmıştır.

Allbatross Portföy Para Piyasası Serbest (TL) Fonu (PRU)'nun unvanında değişiklik yapılarak "Para Piyasası" ifadesinden kaynaklanan "Vadeye Kalan Gün" limitinin fon yatırımcılarının aleyhine sonuçlanacak portföy yönetim kararlarına yol açmasının önlenmesi ve yatırımcı lehine olacak şekilde "Vadeye Kalan Gün" limitinin esnekliğini sağlayarak portföyün yönetilmesinde daha etkin kararlar alınabilmesi hedeflenmektedir

Dönem	Karşılaştırma Ölçütü Bilgisi
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
2.05.2024 - 28.06.2024	6,40%	6,53%	9,26%	-2,86%

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
2.05.2024 - 28.06.2024	0,04%	1,78%	0,04%	1,94%	0,07%	1,86%	-0,05%	2,96%

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

Dönemler	Takip Hatası	Beta
2.05.2024 - 28.06.2024	0,0139	0,6924

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
2024	6,40%	0,71%	9,26%	1,02%

5) Yatırım Fonu Endeksleri Karşılaştırma Tablosu

Dönemler	Portföy	Yatırım Fonu Endeksleri
2.05.2024 - 28.06.2024	6,40%	6,32%

6) Getiri Oranını Etkileyen Piyasa Koşulları

02.05.2024 - 28.06.2024 Dönem Getirisi	Getiri
BIST 100 ENDEKSİ	4,49%
BIST 30 ENDEKSİ	4,35%
BIST-KYD REPO BRÜT ENDEKSİ	8,53%
BIST-KYD DİBS 91 GÜN ENDEKSİ	7,37%
BIST-KYD DİBS 182 GÜN ENDEKSİ	8,78%
BIST-KYD DİBS 365 GÜN ENDEKSİ	8,03%
BIST-KYD DİBS 547 GÜN ENDEKSİ	9,10%
BIST-KYD DİBS TÜM ENDEKSİ	5,57%
BIST-KYD DİBS UZUN ENDEKSİ	2,71%
BIST-KYD ÖSBA SABİT ENDEKSİ	7,03%
BIST-KYD ÖSBA DEĞİŞKEN ENDEKSİ	8,48%
BIST-KYD Kamu Kira Sertifikaları Endeksi	4,62%
BIST-KYD Özel Sektör Kira Sertifikaları Endeksi	6,74%
BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Mevduat Endeksi (TL)	9,26%
BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Kar Payı TL Endeksi	5,53%
BIST Katılım 50 GETİRİ ENDEKSİ	0,03%
BIST-KYD ALTIN FİYAT AĞIRLIKLİ ORTALAMA	1,63%
BIST-KYD Eurobond USD (TL)	3,57%
BIST-KYD Eurobond EUR (TL)	1,67%
Dolar Kuru	1,57%
Euro Kuru	1,51%

	PRU
Net Basit Getiri	6,40%
Gerçekleşen Fon Toplam Giderleri Oranı	1,11%
Azami Toplam Gider Oranı	-
Kurucu Tarafından Karşılana Giderlerin Oranı	0,00%
Net Gider Oranı	1,11%
Brüt Getiri	7,51%