

ZSB-2. İSTATİKSEL AR
Temmuz - 2022 AYLIK RAPORU

1 - FONU TANITICI BİLGİLER

A - FONUN ADI : ZSB-Y İKİNCİ İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ SERBEST FON
B - KURUCUNUN ÜNVANI : ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C - YÖNETİCİNİN ÜNVANI : ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D - FON TUTARI : 1.000.000.000,00
E - FON TOPLAM DEĞERİ : 10.321.579,90
F - TEDAVÜLDEKİ PAY SAYISI : 10.000.000,000
G - FONUN KURULUŞ TARİHİ : 12.04.2022
H - FONUN SÜRESİ : SÜRESİZ

2 - FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A - AY SONU PAY FİYATI : 1,030826
B - ÖNCEKİ AY PAY FİYATI : 1,018763
C - AYLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI : 1,184083
D - YIL BAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI : 3,082600
E - YILLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI : 3,082600
F - AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ
Ters Repo : 6,706678
Borsa Para Piyasası Satış : 93,293322
G - AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI : 1,000000
H - AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI : 0,000000
I - PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ : 1,000000
J - KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ : 0,00
K - KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI : 0,00

3 - FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

A - HİSSE SENETLERİ	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
1. Banka İştirak ve Hissedarları				
2. Diğer Ortaklıklar				
B - DEVLET TAHVİLİ ve HAZİNE BONOLARI	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
C - TERS REPO	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
01.08.2022 TRT080530T19	HAZİNE	20.023	20.022,75	0,193739
D - GELİR ORTAKLIĞI SENEDİ	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
E - DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
F - FİNANSMAN BONOLARI	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
G - ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
H - YABANCI MENKUL KIYMETLER	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
I - ALTIN VE DİĞER DEĞERLİ MADENLER	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
İ - VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
J - BORSA PARA PİYASASI SATIŞ	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
1 01.08.2022		10.314.900	10.314.899,73	99,806261
K - GELİRE ENDEKSLİ SENETLER	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
L - OPSİYON SÖZLEŞMELERİ	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
M - VOB SÖZLEŞMELERİ	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
N - VOB NAKİT TEMİNATI	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
O - KİRA SERTİFİKASI KIYMETLER	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
P - EUROBOND	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
R - VADELİ MEVDUAT	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
S - KATILIM HESABI	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
V - ALTIN KATILIM HESABI	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
Ş - DÖVİZ KATILIM HESABI	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
T - ALTIN VADELİ MEVDUAT	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
U - REPO	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
Y - KATILMA PAYLARI	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
Z - Satış Vaadiyle Alış	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
AA - Alış Vaadiyle Satış	İhraççı	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)

4 - TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

	Tutar	Oran (%)
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	10.334.922,48	100,129269
B. HAZİR DEĞERLER	291,77	0,002827
b) Bankalar	291,77	0,002827
c) Hazır Değerler	0,00	0,000000
a) Takastan Alacaklar T1	0,00	0,000000
b) Takastan Alacaklar T2	0,00	0,000000
d) Temettü Alacakları	0,00	0,000000
e) Diğer Alacaklar	0,00	0,000000
D. DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,000000
b) Geçmiş Yıl Peşin Ödenmiş Vergiler	0,00	0,000000
E. BORÇLAR	13.634,35	0,132096
a) Takasa Borçlar T1	0,00	0,000000
c) Takasa Borçlar	0,00	0,000000
d) Yönetim Ücreti	13.073,27	0,126660
e) Vergi Yasal Yükümlülükler Karşılığı	0,00	0,000000
g) İhtiyatlar	0,00	0,000000
h) Krediler	0,00	0,000000
ı) Pay Geri Alışından Borçlar	0,00	0,000000
k) Diğer Borçlar	169,67	0,001644

FON TOPLAM DEĞERİ	10.321.579,90	100,000000
Toplam Pay Sayısı	1.000.000.000,00	
FİYAT	1,032158	
f) Takastan Alacaklar (Metal-Altın)	0,00	0,000000
l) Takasa Borçlar (Metal Altın)	0,00	0,000000
g) KDV Alacağı	0,00	0,000000
a) Kasa	0,00	0,000000
C. ALACAKLAR	0,00	0,000000
c) Takastan Alacaklar	0,00	0,000000
a) Cari Yıl Peşin Ödenmiş Vergiler	0,00	0,000000
b) Takasa Borçlar T2	0,00	0,000000
f) Ödenecek Vergi Resim Harçlar	0,00	0,000000
j) SPK Kayda Alma Ücreti	391,41	0,003792
Dolaşımdaki Pay Sayısı	10.000.000,000	
h) Takasbank Dışı İşlemlerden Alacaklar	0,00	0,000000
m) Takasbank Dışı İşlemlerden Borçlar	0,00	0,000000
n) Borsa Kotundan Çıkarılan ÖST/ÖSB İçin Ayrılan Karşılık	0,00	0,000000
FİYAT (USD)	0,06	0,000001
FİYAT (EUR)	0,06	0,000001

5 - AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

1 İhrac İzni Ücretleri	173,01
2 İlan Giderleri	0,00
3 Sigorta Ücretleri	0,00
4 Aracılık Komisyon Giderleri	207,80
4 Döviz aracılık komisyonları	0,00
5 Noter Harç ve Tasdik Ücretleri	0,00
6 Fon Yönetim Ücretleri	437,96
7 Vergi, Resim, Harç vb. Giderler	87,30
8 Metal Saklama Giderleri	0,00
8 Saklama Giderleri	76,34
9 Portföy Yönetim Ücreti	12.635,31
10 IMKB Endeksleri Lisans Ücreti	0,00
11 EFT Masrafı	0,00
12 Türev İşlemler Aracılık Komisyonu	0,00

6 -

A) GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI, BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM, TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

Tarih	Kıymet Kodu	İhraççı	Nominal	Tutar	Oran	Açıklama
-------	-------------	---------	---------	-------	------	----------

B) GEÇEN AY İÇİNDE YATIRIM FONLARINA İLİŞKİN MEVZUATTA MEYDANA GELEN DEĞİŞME VE HUKUKİ İHTİLAFLARLA İLGİLİ AÇIKLAMALAR

7 - PORTFÖYDEN SATIŞLAR

Türü Vade Tarihi Tanımı	İhraççı	Satış Tarihi	Nominal Faiz Oran(%)	Nominal Değeri	Satış
Değeri					
BPST 04.07.2022		01.07.2022	0,00	0,000	
10.000.000,00					
BPST 04.07.2022		01.07.2022	0,00	0,000	
200.000,00					
BPST 05.07.2022		04.07.2022	14,70	0,000	
10.200.000,00					
BPST 06.07.2022		05.07.2022	0,00	0,000	
8.644.000,00					
BPST 06.07.2022		05.07.2022	0,00	0,000	
1.556.000,00					
BPST 07.07.2022		06.07.2022	0,00	0,000	
200.000,00					
BPST 07.07.2022		06.07.2022	0,00	0,000	
10.000.000,00					
BPST 08.07.2022		07.07.2022	0,00	0,000	
6.500.000,00					
BPST 08.07.2022		07.07.2022	0,00	0,000	
3.700.000,00					
BPST 13.07.2022		08.07.2022	19,80	0,000	
10.220.000,00					
BPST 14.07.2022		13.07.2022	16,80	0,000	
10.200.000,00					
BPST 18.07.2022		14.07.2022	16,00	0,000	
10.200.000,00					
BPST 19.07.2022		18.07.2022	15,35	0,000	
10.000.000,00					
BPST 20.07.2022		19.07.2022	0,00	0,000	
8.500.000,00					
BPST 20.07.2022		19.07.2022	0,00	0,000	
1.500.000,00					
BPST 21.07.2022		20.07.2022	0,00	0,000	
2.511.000,00					
BPST 21.07.2022		20.07.2022	0,00	0,000	
7.000.000,00					

BPST 21.07.2022 489.000,00	20.07.2022	0,00	0,000
BPST 22.07.2022 10.000.000,00	21.07.2022	18,50	0,000
BPST 25.07.2022 9.867.000,00	22.07.2022	0,00	0,000
BPST 25.07.2022 133.000,00	22.07.2022	0,00	0,000
BPST 26.07.2022 1.253.000,00	25.07.2022	0,00	0,000
BPST 26.07.2022 8.747.000,00	25.07.2022	0,00	0,000
BPST 27.07.2022 4.629.000,00	26.07.2022	0,00	0,000
BPST 27.07.2022 5.371.000,00	26.07.2022	0,00	0,000
BPST 28.07.2022 4.786.000,00	27.07.2022	0,00	0,000
BPST 28.07.2022 2.900.000,00	27.07.2022	0,00	0,000
BPST 28.07.2022 2.614.000,00	27.07.2022	0,00	0,000
BPST 01.08.2022 10.300.000,00	29.07.2022	17,60	0,000

8 - İTFALAR

Türü Vade Tarihi Tanımı	İhraççı	İtfa Tarihi	Nominal Değeri
-------------------------	---------	-------------	----------------

9 - PORTFÖYE ALIŞLAR

Türü Vade Tarihi Tanımı	İhraççı	Alış Tarihi	Nominal Faiz Oran(%)	Nominal Değeri	Alış
Değeri					
TRPO 05.07.2022 TRT080530T19 10.000,00	HAZİNE	04.07.2022	13,57	5.795,000	
TRPO 06.07.2022 TRT080530T19 20.000,00	HAZİNE	05.07.2022	12,89	11.578,000	
TRPO 07.07.2022 TRT080530T19 10.000,00	HAZİNE	06.07.2022	13,10	5.783,000	
TRPO 08.07.2022 TRT080530T19 10.000,00	HAZİNE	07.07.2022	12,64	5.777,000	
TRPO 14.07.2022 TRT080530T19 40.000,00	HAZİNE	13.07.2022	13,42	22.970,000	
TRPO 18.07.2022 TRT080530T19 50.000,00	HAZİNE	14.07.2022	12,10	28.683,000	
TRPO 19.07.2022 TRT080530T19 260.000,00	HAZİNE	18.07.2022	13,10	148.557,000	
TRPO 20.07.2022 TRT080530T19 270.000,00	HAZİNE	19.07.2022	13,49	154.117,000	
TRPO 21.07.2022 TRT080530T19 270.000,00	HAZİNE	20.07.2022	13,22	153.963,000	
TRPO 22.07.2022 TRT080530T19 280.000,00	HAZİNE	21.07.2022	13,92	159.506,000	
TRPO 25.07.2022 TRT080530T19 280.000,00	HAZİNE	22.07.2022	13,50	159.346,000	
TRPO 26.07.2022 TRT080530T19 300.000,00	HAZİNE	25.07.2022	13,75	170.219,000	
TRPO 27.07.2022 TRT080530T19 300.000,00	HAZİNE	26.07.2022	12,79	170.050,000	
TRPO 28.07.2022 TRT080530T19 10.000,00	HAZİNE	27.07.2022	13,78	5.663,000	
TRPO 29.07.2022 TRT080530T19 310.000,00	HAZİNE	28.07.2022	0,00	175.370,000	
TRPO 29.07.2022 TRT080530T19 10.000.000,00	HAZİNE	28.07.2022	0,00	5.657.101,000	
TRPO 01.08.2022 TRT080530T19 20.000,00	HAZİNE	29.07.2022	13,84	11.303,000	