

ATA PORTFÖY BİRİNCİ SERBEST FON

**1 OCAK-31 ARALIK 2017 DÖNEMİNE AİT
FİYAT RAPORU**

ATA PORTFÖY BİRİNCİ SERBEST FON

Pay Fiyatının Hesaplanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer / Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporlarının Mevzuata Uygun Olarak Hazırlanmasına İlişkin Rapor

Ata Portföy Birinci Serbest Fon'unun ("Fon") pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 31 Aralık 2017 tarihi itibarıyla hazırlanan portföy değeri tablosu ve toplam değer / net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporlarının 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Esaslarına İlişkin Tebliğ (II-14.2) ("Tebliğ") hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca ("SPK") belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını SPK'nın konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2017 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Ata Portföy Birinci Serbest Fon'unun pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 31 Aralık 2017 tarihi itibarıyla hazırlanan portföy değeri tablosu ve toplam değer / net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporları Tebliğ hükümlerine ve SPK tarafından belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanmıştır.

Bu görüş tamamen SPK, Kurucu Yönetim Kurulu ve Ata Portföy Yönetimi A.Ş.'nin ("Kurucu") bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka maksatla kullanılması mümkün değildir.

DRT BAĞIMSIZ DENETİM VE SERBEST MUHASEBECİ MALİ MÜŞAVİRLİK A.Ş.
Member of **DELOITTE TOUCHE TOHMATSU LIMITED**

H. Ali Bekçe, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 1 Mart 2018

31/12/2017 Tarihli(Ata Portföy Birinci Serbest Fon) Fon Toplam Deger Raporu

	TUTARI(TL)	GRUP (%)	TOPLAM (%)		TUTARI(TL)	GRUP (%)	TOPLAM (%)
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	38.186.923,75		100,28%		38.082.028,71		
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ)	38.186.923,76		100,28%	FON TOPLAM DEĞERİ	38.082.028,71		
B. HAZIR DEĞERLER	844,21		0,00%	Toplam Pay Sayısı	25.000.000.000		
a) Kasa	0	0,00%	0,00%	Dolaşımdaki Pay Sayısı	2.294.227.597,00		
b) Bankalar	0	0,00%	0,00%	Kurucunun Elindeki Pay Sayısı	0		
i) TL Hesaplar	0	0,00%	0,00%	Merkezdeki Pay Sayısı	22.705.772.403		
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	0	0,00%	0,00%	Fiyat	0,016599		
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	0	0,00%	0,00%	(VOB Açık Pozisyon)	31.944.000		83,88%
c) Diğer Hazır Değerler	844,21	100,00%	0,00%	Pay Sahibi Sayısı	0		
C. ALACAKLAR	0		0,00%	Günlük Yönetim Ücreti	46546,95		
a) Takastan Alacaklar T1	0		0,00%	Dünkü Fiyat			
b) Takastan Alacaklar T2	0		0,00%				
c) Takastan BPP Alacakları	0		0,00%				
d) Diğer Alacaklar	0		0,00%				
D. DİĞER VARLIKLAR	0		0,00%				
E. BORÇLAR	105.739,25		-0,28%				
a) Takasa Borçlar T1	0	0,00%	0,00%				
b) Takasa Borçlar T2	0	0,00%	0,00%				
c) Yönetim Ücreti	51.242,66	48,46%	-0,13%				
d) Ödenecek Vergi	0	0,00%	0,00%				
e) İhtiyatlar	0	0,00%	0,00%				
f) Krediler	0	0,00%	0,00%				
g) Diğer Borçlar	54.496,59	51,54%	-0,14%				
i) Denetim Ücreti	3.250,44	3,07%	-0,01%				
ii) İlan Giderleri	0	0,00%	0,00%				
iii) Noter Masrafı	0	0,00%	0,00%				
iv) İhraç İzin Gideri	1.589,28	1,50%	0,00%				
v) Takas Saklama Komisyonu	0	0,00%	0,00%				
vi) Diğer	49.656,87	46,96%	-0,13%				
F. M.D.Düşüş Karşılığı	0		0,00%				
FON TOPLAM DEĞERİ	38.082.028,71						

31/12/2017 Tarihli(Ata Portföy Birinci Serbest Fon) Fon Portföy Raporu

Menkul Krymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Faiz	Nominal Ödeme Sırası	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Borsa Sözleşme No	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)	F.T.D. (%)	Depo VKG	Stok Depo
A.HİSSE																			
SENEDİ																			
B.BORÇLANMA																			
SENETLERİ																			
C. KATILMA																			
BELGESİ																			
YERLİ KATILMA BELGESİ			BİRİNCİ HİSSE			140.000.000,00	0,093614	26/09/2017				0,138426		19.379.640,00	53,07%	50,75%	50,89%	SRB	0
			İKİNCİ HİSSE			515.000.000,00	0,01472	26/09/2017				0,023984		12.351.760,00	33,82%	32,35%	32,43%	SRB	0
			2.SERBEST			3.311.000,00	1,079035	04/11/2016				1,446431		4.789.133,04	13,11%	12,54%	12,58%	SRB	0
GRUP TOPLAMI						658.311.000,00								36.520.533,04		95,64%	95,90%		
D. OPSİYON																			
İŞLEMLER																			
E.YABANCI																			
HİSSE																			
F.TERS																			
REPO																			
G.KATILIM																			
HESABI																			
H.VADELİ																			
MEVDUAT																			
İ.KIYMETLİ																			
MADEN																			
J.YABANCI																			
TAHVİL																			
K.BORSA PARA																			
PIYASASI																			
L.VARANT																			
İŞLEMLERİ																			
M.TEMİNAT																			
İŞLEMLERİ																			
VOB Nakit						1.666.390,71	1	13/04/2012					1	1.666.390,71	100,00%	4,36%	4,38%		
GRUP TOPLAMI						1.666.390,71								1.666.390,71		4,36%	4,38%		
N.SWAP																			
İŞLEMLERİ																			
O.EUROBOND																			
REPO																			
FON																			
PORTFÖY						659.977.390,71					0			38.186.923,75					
DEĞERİ																			
VOB SÖZLEŞMESİ																			
Kısa Pozisyon	Kısa	28/02/2018	F XU0300218			-2.200,00	144,6215	29/12/2017				145,2	1	-31.944.000,00					61
TOPLAM						-2.200,00								-31.944.000,00					
GRUP TOPLAMI						2.200,00								31.944.000,00		83,65%			