

Ata Portföy Dengeli Değişken Fonu

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

Ata Portföy Dengeli Değişken Fonu'nun 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 Dengeli Değişken Fon'un pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 31 Aralık 2023 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 (11-14.2) hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını Sermaye Piyasası Kurulu'nun konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2023 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Ata Portföy Dengeli Değişken Fon'un pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 31 Aralık 2023 tarihi itibarıyla hazırlanan portföy değeri tablosu ve toplam değer/net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporları 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete' de yayımlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Esaslarına ilişkin Tebliğ (II-14.2)" hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanmıştır.

Bu görüş tamamen Sermaye Piyasası Kurulu ve Ata Portföy Yönetimi Anonim Şirketi'nin ("Kurucu") bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka maksatla kullanılması mümkün değildir.

GÜRELİ YEMİNLİ MALİ MÜŞAVİRLİK VE BAĞIMSIZ DENETİM HİZMETLERİ A.Ş.
An Independent Member of BAKER TILLY INTERNATIONAL



İstanbul, 19.04.2024
Tülin EROL
Sorumlu Denetçi

www.gureli.com.tr

Merkez Ofisi
Spine Tower Maslak Mah. Saat Sok.
No: 5 Kat: 25-26-28
Sarıyer 34485 - İstanbul
T : 444 9 475 (212) 285 01 50
F : +90 (212) 285 03 40-43
gym@gureli.com.tr

Ankara Ofisi
ASO Kule Atatürk Bulvarı
No: 193 Kat: 9
Kavaklıdere 06680 - Ankara
T : +90 (312) 466 84 20
F : +90 (312) 466 84 21
gymankara@gureli.com.tr

Antalya Ofisi
Fener Mah.1964 Sok. No: 36
Kemal Erdoğan Apt. Kat: 1 D: 4
Muratpaşa 07160 - Antalya
T : +90 (242) 324 30 14
F : +90 (242) 324 30 15
gymantalya@gureli.com.tr

Bursa Ofisi
Odunluk Mah. Akademi Cad.
Zeno İş Merkezi D Blok Kat: 7 D: 31
Nilüfer 16265 - Bursa
T : +90 (224) 451 27 10
F : +90 (224) 451 27 79
gymbursa@gureli.com.tr

İzmir Ofisi
Atatürk Cad. Ekim Apt.
No: 174/1 Kat: 5 D: 9
Alsancak 35220 - İzmir
T : +90 (232) 421 21 34
F : +90 (232) 421 21 87
gymizmir@gureli.com.tr

Trakya Ofisi
Yavuz Mah. Ferman Sok.
No: 3/7 Kat: 2
Süleymanpaşa 59100 - Tekirdağ
T : +90 (282) 261 25 30
F : +90 (282) 261 62 56
gymtrakya@gureli.com.tr

ATA PORTFÖY DENGELİ DEĞİŞKEN FON

31 Aralık 2023 Tarihli
Fiyat Raporu Tablosu EK-1 (a)

Sermaye piyasası Aracı	İhraççı	Vade	İşin Kodu	Nominal Faiz Oranı	Vadeye Kalan Gün	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Borsa Sözleşme No	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Değer	Toplam Değer/Net Varlık Değer	Grup (%)	Toplam (%)
A.HİSSE SENEDİ	AG ANADOLU GRUBU HOLDING A.Ş.		AGHOL				2.764	197,552786	28.12.2023				200,90000	555.288	7,27	1,22
	AKBANK T.A.Ş.		AKBNK				15.904	34,376766	28.12.2023				36.52000	580.814	7,60	1,28
	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.		BIMAS				1.772	308,127398	28.12.2023				300,75000	532.929	6,98	1,17
	COCA-COLA İÇECEK A.Ş.		CCOLA				1.251	436,046763	28.12.2023				525,50000	657.401	8,60	1,45
	KOÇ HOLDING A.Ş.		KCHOL				3.857	141,588774	28.12.2023				141,80000	546.923	7,16	1,21
	MIGROS TİCARET A.Ş.		MIGROS				1.555	350,419132	28.12.2023				335,00000	520.925	6,82	1,15
	MedikalPark Sağlık Hizmetleri A.Ş.		MPARK				3.663	149,155801	28.12.2023				149,00000	545.787	7,14	1,20
	SABANCI HOLDING A.Ş.		SAHOL				8.862	61,575671	28.12.2023				60,45000	535.708	7,01	1,18
	TAV HAVAALIMANLARI HOLDING A.Ş.		TAVHL				4.751	114,739907	28.12.2023				107,50000	510.733	6,68	1,13
	TÜRKCELL İLETİŞİM HİZ. A.Ş.		TCELL				9.710	56,168234	28.12.2023				56,10000	544.731	7,13	1,20
	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.		THYAO				2.351	243,158826	28.12.2023				228,60000	537.439	7,03	1,18
	TÜPRAŞ TÜRKİYE PETROL RAFİNERİLERİ A.Ş.		TUPRS				3.599	151,362351	28.12.2023				143,00000	514.657	6,74	1,13
	ÜLKER BİSKÜVİ SANAYİ A.Ş.		ULKER				6.478	82,517104	28.12.2023				81,85000	530.224	6,94	1,17
	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.		YKBNK				26.946	20,500546	28.12.2023				19,54000	526.525	6,89	1,16
	GRUP TOPLAMI						93.463							7.640.082		16,84
B.BORÇLANMA SENETLERİ																
DEVLET TAHVİLİ	Hazine ve Maliye Bakanlığı	01.10.2025	TRT011025T16	6,3	639	6	2.000.000	72,411539	04.12.2023	22,64			74,40094	1.488.019	4,07	3,28
	Hazine ve Maliye Bakanlığı	13.07.2033	TRT130733T17	17,8	3.481	6	1.500.000	85,902015	15.12.2023	3,33			86,18281	1.292.742	3,54	2,85
GRUP TOPLAMI							3.500.000							2.780.761		6,13
FİNANSMAN BONOSU	Ak Finansal Kiralama A.Ş.	07.06.2024	TRFAKF62417	23,03	158	12	1.000.000	100	13.12.2023	53,34			102,369941	1.023.699	2,80	2,26
	Aktif Yatırım Bankası A.Ş.	01.03.2024	TRFAKY832436	-	60	0	1.000.000	90,616	08.12.2023	53,45			93,312714	933.127	2,55	2,06
	ALTERNATİF YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.	02.05.2024	TRFALFK52416	-	122	0	600.000	84,142618	27.11.2023	48,45			87,723721	526.342	1,44	1,16
	Doğan Yatırım Bankası A.Ş.	04.01.2024	TRFDBNK12419	-	3	0	30.000	87,9179	25.08.2023	42,94			99,804417	29.941	0,08	0,07
	Devra Holding A.Ş.	14.11.2024	TRFDEVAK2415	46,87	318	6	2.000.000	101,655433	08.12.2023	47,03			105,088455	2.101.769	5,75	4,63
	Doğan Trend Otomotiv Ticaret Hizmet ve Teknoloji A.Ş.	29.03.2024	TRFDGTR32418	-	88	0	500.000	105,74999	24.11.2023	0			111,003265	555.016	1,52	1,22
	DENİZ YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.	15.05.2024	TRFDNZY52415	20,83	135	12	1.000.000	100	29.11.2023	50,84			103,903151	1.039.032	2,84	2,29
	DARDANEL ÖNENTAŞ GIDA SANAYİ A.Ş.	03.05.2024	TRFDORD52410	23,15	123	12	2.500.000	103,719842	27.12.2023	54			106,596204	2.664.905	7,29	5,87
	ÜNİLÜ MENKUL DEĞERLER A.Ş.	04.01.2024	TRFDUUM12410	1,24	3	12	250.000	106,299004	20.11.2023	0			112,083981	280.210	0,77	0,62
	FASDAT Gıda Dağıtım Sanayi ve Ticaret A.Ş.	15.03.2024	TRFFSDT32418	-	74	0	1.000.000	88,9	08.12.2023	54,99			91,608765	916.088	2,51	2,02
	Info Yatırım Menkul Değerler A.Ş.	26.01.2024	TRFINFM12415	-	25	0	600.000	92,868063	27.11.2023	52,93			97,245228	583.471	1,60	1,29
	Info Yatırım Menkul Değerler A.Ş.	26.01.2024	TRFINFM12423	-	25	0	150.000	92,465227	17.11.2023	50,46			97,349744	146.025	0,40	0,32
	Info Yatırım Menkul Değerler A.Ş.	01.03.2024	TRFINFM32413	-	60	0	1.500.000	92,243229	27.12.2023	57,37			92,952826	1.393.992	3,81	3,07
	Koç Sistem Bilgi ve İletişim Hizmetleri A.Ş.	16.04.2024	TRFKCSS42411	22,07	106	12	500.000	103,722436	24.11.2023	50,17			108,593195	542.966	1,49	1,20
	KORTEKS MEN. SAN. VE TİC. A.Ş.	26.04.2024	TRFKORT42416	19,46	116	12	1.000.000	100	30.11.2023	53,87			104,295875	1.042.959	2,85	2,30
	Osmanlı Yatırım Menkul Değerler A.Ş.	16.02.2024	TRFOSMK22411	1,39	46	12	600.000	103,455888	27.11.2023	49,65			108,375937	505.256	1,78	1,43
	PINAR ENTEGRE ET VE UN SANAYİ A.Ş.	29.03.2024	TRFPUN32412	21,34	88	12	600.000	105,885012	27.11.2023	49,01			110,333759	662.003	1,81	1,46
	ŞİŞE CAM	24.09.2024	TRFSISE92416	11,97	267	3	700.000	109,402981	24.11.2023	12,72			102,614211	718.299	1,97	1,58
	Suzuki Motorlu Araçlar Pazarlama A.Ş.	04.01.2024	TRFSUZK12429	13,36	3	6	40.000	102,542	26.09.2023	43,87			113,134296	45.254	0,12	0,10
	Suzuki Motorlu Araçlar Pazarlama A.Ş.	14.03.2024	TRFSUZK32419	21,34	73	12	600.000	107,587057	27.11.2023	49,03			112,15632	672.938	1,84	1,48
	Tam Finans Faktoring A.Ş.	13.03.2024	TRFTAMF32417	-	72	0	500.000	101,12076	24.11.2023	0			106,235388	531.177	1,45	1,17
	TAT GIDA SANAYİ A.Ş.	15.04.2024	TRFTATK42437	22,07	105	12	500.000	103,711484	24.11.2023	50,18			108,713856	543.569	1,49	1,20
	Ulusal Faktoring	12.01.2024	TRFULFK12426	15,31	11	12	500.000	108,520888	24.11.2023	50,59			114,023448	570.117	1,56	1,26
	VDF FİLO KİRALAMA A.Ş.	05.04.2024	TRVFDFK42410	11,22	95	12	500.000	105,16535	24.11.2023	2,73			110,450321	552.252	1,51	1,22
	Vakıf Faktoring A.Ş.	27.02.2024	TRVFVAS22478	-	57	0	1.000.000	90,213	01.12.2023	53,3			93,65585	936.558	2,56	2,06
	Yapi Kredi Yatırım Menkul Değerler A.Ş.	29.02.2024	TRFYKYM22426	-	59	0	900.000	90,017	29.11.2023	51,78			93,584645	842.262	2,30	1,86
	GRUP TOPLAMI						20.070.000							20.504.228		45,18
ÖZEL KİRA SERTİFİKALARI	Yatırım Varlık Kiralama A.Ş.	09.01.2024	TRDYVKS12417	20,11	8	6	20.000	104,0258	22.08.2023	44,78			119,257395	23.851	0,07	0,05
	Mlp Sağlık Hizmetleri A.Ş. (Medikalpark Sağlık Hizmetleri A.Ş.)	12.06.2025	TRDYVKS62511	12,33	528	12	2.440.000	101,201721	27.12.2023	6,37			102,747859	2.507.048	6,86	5,52
GRUP TOPLAMI							2.460.000							2.530.899		5,57
ÖZEL SEKTÖR TAHVİL	İş Gayrimenkul Yatırım Ortaklığı A.Ş.	03.11.2025	TRISGYK2519	23,80	672	3	2.000.000	102,047701	08.12.2023	8,84			105,957491	2.119.150	5,80	4,67
	Koç Finansman A.Ş.	02.12.2025	TRSKCTFA2513	24,43	701	3	2.000.000	100,7805	08.12.2023	9,86			103,902564	2.078.051	5,69	4,58
	Koç Finansman A.Ş.	03.11.2025	TRSKCTFK2511	23,68	672	3	1.500.000	106,488934	27.12.2023	8,07			107,235862	1.608.538	4,40	3,54
	Mlp Sağlık Hizmetleri A.Ş. (Medikalpark Sağlık Hizmetleri A.Ş.)	01.10.2024	TRSMLPCE2414	12,22	274	6	1.500.000	107,43417	05.12.2023	0,29			111,97835	1.679.675	4,60	3,70
	Vestel Elektronik San. Ve Tic. A.Ş.	01.11.2024	TRSVSTLK2421	12,03	305	3	1.500.000	104,976404	05.12.2023	2,81			109,469773	1.642.047	4,49	3,62
	Zorlu Enerji Elektrik Üretim A.Ş.	14.11.2024	TRSDORNK2421	12,34	318	3	1.500.000	102,444949	05.12.2023	5,73			107,032949	1.605.494	4,39	3,54
GRUP TOPLAMI							10.000.000							10.732.955		23,65
FON PORTFÖY DEĞERİ							36.123.463							44.188.925		
C.TEMİNAT İŞLEMLERİ																
GRUP TOPLAMI	TRY Teminat						1.190.441	1	29.12.2023				1	1.190.441	100	2,62
							1.190.441							1.190.441		2,62
VOB SÖZLEŞMELERİ																
GRUP TOPLAMI	Uzun	29.02.2024	F_USDTRY0224 (LONG)		59		100	31,139393	25.12.2023				31,375	3.137.500	43,28	6,91
	Uzun	29.02.2024	F_XAUTRYM0224 (LONG)		59		1.950	2092,946585	26.12.2023				2108,8	4.112.160	56,72	9,06
GRUP TOPLAMI							2.050							7.249.660		15,97

ATA PORTFÖY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI (TL) FONU

31 Aralık 2022 Tarihli
Fiyat Raporu Tablosu EK-1 (a)

Sermaye piyasası Aracı	İhraççı	Vade	İşin Kodu	Nominal Faiz Oranı	Vadeye Kalan Gün	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç iskonto Oranı	Borsa Sözleşme No	Repo Teminat Tutar	Günlük Birim Değer	Toplam Değer/Net Varlık Değer	Grup (%)	Toplam (%)
A.BORÇLANMA SENETLERİ																
DEVLET TAHVİLİ																
	T.C. HAZİNE VE MALİYE BAKANLIĞI	18.01.2023	TRT1B0123T10	6,10	17	-	350.000	99,013462	24.10.2022	10,60			105,632438	369.714	34,82	30,60
	T.C. HAZİNE VE MALİYE BAKANLIĞI	25.01.2023	TRT2S0123T11	11,15	24	-	400.000	89,971726	24.10.2022	10,58			99,368124	397.473	37,44	32,90
GRUP TOPLAMI							750.000							767.186		63,51
B.BORÇLANMA SENETLERİ																
FINANSMAN BONOSU																
	AK YATIRIM MENKUL DEĞERLER A.Ş.	07.03.2023	TRFAKYM32318	7,43	65		100.000	93,08019	24.10.2022	21,57			93,08019	96.633	9,10	0,08
	Faizdat Gıda Dağıtım Sanayi Ve Ticaret A.Ş.	24.01.2023	TRFFSDT12311	4,04	23		100.000	96,11144	30.11.2022	30,12			96,11440	98.426	9,27	6,15
	YAPI KREDİ BANKASI A.Ş.	13.01.2023	TRFYKBK12312	4,48	12		100.000	95,71569	24.10.2022	21,82			95,71569	99.407	9,36	8,23
GRUP TOPLAMI							300.000							294.465		24,38
FON PORTFÖY DEĞERİ							1.050.000							1.061.651		87,88
C.TEMİNAT İŞLEMLERİ																
GRUP TOPLAMI			Teminat				146.384	1	30.12.2022				1	146.384	1	12,20
							146.384							146.384		12,20

ATA PORTFÖY DENGELİ DEĞİŞKEN FON

31 Aralık 2023 Tarihli

Fiyat Raporu Tablosu EK-1 (b)

	31 Aralık 2023			31 Aralık 2022		
	TUTARI (TL)	GRUP %	TOPLAM %	TUTARI (TL)	GRUP %	TOPLAM %
A.FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ	44.188.925	100,00	97,49	1.061.651	100,00	88,47
	-	-	-	-	-	-
B. HAZIR DEĞERLER (+)	1.190.441	100,00	2,63	146.384	100,00	12,20
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	-	-	-	-	-	-
c) Diğer Hazır Değerler	1.190.441	100,00	2,63	146.384	13,79	12,20
	-	-	-	-	-	-
C.ALACAKLAR (+)	65.012	100,00	0,14	4.133	100,00	0,34
a) Takastan Alacaklar	-	-	-	-	-	-
b) Diğer Alacaklar	65.012	100,00	0,14	4.133	100,00	0,34
	-	-	-	-	-	-
Ç. DİĞER VARLIKLAR (+)	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
D. BORÇLAR (-)	118.254	100,00	0,26	12.097	100,00	1,01
a) Takasa Borçlar	-	-	-	-	-	-
b) Yönetim Ücreti	40.249	34,04	0,09	1.312	10,84	0,11
c) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
ç) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
d) Krediler	-	-	-	-	-	-
e) Diğer Borçlar	78.005	65,96	0,17	10.785	89,16	0,90
f) Denetim Ücretleri	-	-	-	-	-	-
g)Kayda alma ücreti	-	-	-	-	-	-
h)Vergi resim harç	-	-	-	-	-	-
TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	45.326.123	100,00	100,00	1.200.071	100,00	100,00
	-	-	-	-	-	-
Toplam Katılma Payı/Pay Sayısı	1.700.000.000			1.700.000.000		
Yatırım Fonları İçin Kurucu Tarafından İktisap Edilen Katılma Payı	1.688.490.609			1.699.625.694		
Dolaşımdaki Pay Sayısı	11.509.391			374.306		
Birim Pay Değeri	3,938186			3,20612		