

ZSB-2. İSTATİKSEL AR
Mayıs - 2022 AYLK 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 : 10.082.642,16
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 : 1,007857
B - ÖNCEKİ AY PAY FİYATI : 1,000000
C - AYLK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI : 0,785700
D - YIL BAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI : 0,785700
E - YILLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI : 0,785700
F - AYLK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ
Ters Repo : 11,442817
Borsa Para Piyasası Satış : 71,890516
Diğer : 16,666667
G - AYLK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI : 0,882353
H - AYLK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI : 0,000000
I - PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ : 1,000000
J - KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ : 10.000.000,00
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 (%)
01.06.2022 TRT080530T19	HAZİNE	80.030	80.029,65	0,793570
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 01.06.2022		945.447	945.446,61	9,374996
2 01.06.2022		9.059.292	9.059.291,82	89,831434
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

A. FON PORTFÖY DEĞERİ	Tutar	Oran (%)
B. HAZİR DEĞERLER	10.084.768,08	100,021085
b) Bankalar	7.416,64	0,073558
c) Hazır Değerler	7.416,64	0,073558
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	9.542,56	0,094643
a) Takasa Borçlar T1	0,00	0,000000
c) Takasa Borçlar	0,00	0,000000
d) Yönetim Ücreti	9.082,20	0,090078
e) Vergi Yasal Yükümlülükler Karşılığı	0,00	0,000000
g) İhtiyatlar	0,00	0,000000
h) Krediler	0,00	0,000000

1) Pay Geri Alışından Borçlar	0,00	0,000000
k) Diğer Borçlar	247,70	0,002457
FON TOPLAM DEĞERİ	10.082.642,16	100,000000
Toplam Pay Sayısı	1.000.000.000,00	
FİYAT	1,008264	
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	212,66	0,002109
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	212,66
2 İlan Giderleri	0,00
3 Sigorta Ücretleri	0,00
4 Aracılık Komisyon Giderleri	329,69
4 Döviz aracılık komisyonları	0,00
5 Noter Harç ve Tasdik Ücretleri	0,00
6 Fon Yönetim Ücretleri	304,27
7 Vergi, Resim, Harç vb. Giderler	87,30
8 Metal Saklama Giderleri	0,00
8 Saklama Giderleri	37,28
9 Portföy Yönetim Ücreti	8.777,93
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 TAHSİLİNE 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	11.05.2022			10.05.2022	0,00	0,000	
9.175.000,00							
BPST	11.05.2022			10.05.2022	0,00	0,000	
725.000,00							
BPST	12.05.2022			11.05.2022	15,95	0,000	
10.000.000,00							
BPST	16.05.2022			13.05.2022	0,00	0,000	
3.332.000,00							
BPST	16.05.2022			13.05.2022	0,00	0,000	
3.000.000,00							
BPST	16.05.2022			13.05.2022	0,00	0,000	
3.668.000,00							
BPST	17.05.2022			16.05.2022	15,95	0,000	
10.000.000,00							
BPST	18.05.2022			17.05.2022	16,30	0,000	
10.000.000,00							
BPST	20.05.2022			18.05.2022	16,05	0,000	
10.000.000,00							
BPST	23.05.2022			20.05.2022	16,05	0,000	
10.000.000,00							
BPST	24.05.2022			23.05.2022	16,35	0,000	
10.000.000,00							
BPST	25.05.2022			24.05.2022	16,90	0,000	
10.000.000,00							
BPST	27.05.2022			26.05.2022	0,00	0,000	
5.222.000,00							
BPST	27.05.2022			26.05.2022	0,00	0,000	
4.778.000,00							
BPST	30.05.2022			27.05.2022	16,05	0,000	
10.000.000,00							
BPST	31.05.2022			30.05.2022	0,00	0,000	
241.000,00							

BPST 31.05.2022	30.05.2022	0,00	0,000
9.759.000,00			
BPST 01.06.2022	31.05.2022	0,00	0,000
945.000,00			
BPST 01.06.2022	31.05.2022	0,00	0,000
9.055.000,00			

8 - İTFALAR

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

9 - PORTFÖYE ALIŞLAR

Türü	Vade Tarihi	Tanımlı	İhraççı	Alış Tarihi	Nominal Faiz Oran(%)	Nominal Değeri	Alış
TRPO	11.05.2022	TRT080530T19	HAZİNE	10.05.2022	12,45	58.412,000	
90.000,00							
TRPO	13.05.2022	TRT080530T19	HAZİNE	12.05.2022	13,39	6.467.092,000	
10.000.000,00							
TRPO	16.05.2022	TRT080530T19	HAZİNE	13.05.2022	11,70	6.456,000	
10.000,00							
TRPO	17.05.2022	TRT080530T19	HAZİNE	16.05.2022	13,42	12.842,000	
20.000,00							
TRPO	18.05.2022	TRT080530T19	HAZİNE	17.05.2022	13,64	12.820,000	
20.000,00							
TRPO	20.05.2022	TRT080530T19	HAZİNE	18.05.2022	13,07	19.196,000	
30.000,00							
TRPO	23.05.2022	TRT080530T19	HAZİNE	20.05.2022	13,05	25.504,000	
40.000,00							
TRPO	24.05.2022	TRT080530T19	HAZİNE	23.05.2022	13,76	31.713,000	
50.000,00							
TRPO	25.05.2022	TRT080530T19	HAZİNE	24.05.2022	12,27	31.657,000	
50.000,00							
TRPO	26.05.2022	TRT080530T19	HAZİNE	25.05.2022	0,00	6.320.393,000	
10.000.000,00							
TRPO	26.05.2022	TRT080530T19	HAZİNE	25.05.2022	0,00	37.922,000	
60.000,00							
TRPO	27.05.2022	TRT080530T19	HAZİNE	26.05.2022	13,96	37.856,000	
60.000,00							
TRPO	30.05.2022	TRT080530T19	HAZİNE	27.05.2022	13,54	44.089,000	
70.000,00							
TRPO	31.05.2022	TRT080530T19	HAZİNE	30.05.2022	13,68	50.126,000	
80.000,00							
TRPO	01.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	31.05.2022	13,53	50.039,000	
80.000,00							