

ZSB-2. İSTATİKSEL AR
Haziran - 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 : 10.192.128,45
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 : 1,018763
B - ÖNCEKİ AY PAY FİYATI : 1,007857
C - AYLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI : 1,082098
D - YIL BAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI : 1,876300
E - YILLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI : 1,876300
F - AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ
Ters Repo : 19,203520
Borsa Para Piyasası Satış : 80,796480
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 (%)
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 01.07.2022		3.114.591	3.114.590,62	30,519616
2 01.07.2022		2.088.064	2.088.063,51	20,460762
3 01.07.2022		5.002.555	5.002.554,79	49,019622
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	10.205.208,92	100,128339
B. HAZIR DEĞERLER	646,89	0,006347
b) Bankalar	646,89	0,006347
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	13.727,36	0,134686
a) Takasa Borçlar T1	0,00	0,000000
c) Takasa Borçlar	0,00	0,000000
d) Yönetim Ücreti	12.499,01	0,122634
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	718,74	0,007052
FON TOPLAM DEĞERİ	10.192.128,45	100,000000
Toplam Pay Sayısı	1.000.000.000,00	
FİYAT	1,019213	
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	509,61	0,005000
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	296,95
2 İlan Giderleri	0,00
3 Sigorta Ücretleri	0,00
4 Aracılık Komisyon Giderleri	1.004,93
4 Döviz aracılık komisyonları	0,00
5 Noter Harç ve Tasdik Ücretleri	0,00
6 Fon Yönetim Ücretleri	418,72
7 Vergi, Resim, Harç vb. Giderler	87,30
8 Metal Saklama Giderleri	0,00
8 Saklama Giderleri	71,82
9 Portföy Yönetim Ücreti	12.080,29
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 02.06.2022		01.06.2022	17,75	0,000	
10.000.000,00					
BPST 03.06.2022		02.06.2022	0,00	0,000	
193.000,00					
BPST 03.06.2022		02.06.2022	0,00	0,000	
4.807.000,00					
BPST 03.06.2022		02.06.2022	0,00	0,000	
5.000.000,00					
BPST 08.06.2022		07.06.2022	15,00	0,000	
10.000.000,00					
BPST 09.06.2022		08.06.2022	14,75	0,000	
10.000.000,00					
BPST 10.06.2022		09.06.2022	15,90	0,000	
10.000.000,00					
BPST 13.06.2022		10.06.2022	0,00	0,000	
1.606.000,00					
BPST 13.06.2022		10.06.2022	0,00	0,000	
8.394.000,00					
BPST 14.06.2022		13.06.2022	0,00	0,000	
5.000.000,00					
BPST 14.06.2022		13.06.2022	0,00	0,000	
5.000.000,00					
BPST 15.06.2022		14.06.2022	16,50	0,000	
10.000.000,00					
BPST 16.06.2022		15.06.2022	0,00	0,000	
6.405.000,00					
BPST 16.06.2022		15.06.2022	0,00	0,000	
3.595.000,00					
BPST 17.06.2022		16.06.2022	16,65	0,000	
10.000.000,00					
BPST 20.06.2022		17.06.2022	0,00	0,000	
1.111.000,00					

BPST 20.06.2022	17.06.2022	0,00	0,000
8.889.000,00			
BPST 21.06.2022	20.06.2022	16,25	0,000
10.000.000,00			
BPST 24.06.2022	23.06.2022	0,00	0,000
7.229.000,00			
BPST 24.06.2022	23.06.2022	0,00	0,000
2.771.000,00			
BPST 27.06.2022	24.06.2022	16,55	0,000
10.000.000,00			
BPST 28.06.2022	27.06.2022	16,25	0,000
10.000.000,00			
BPST 29.06.2022	28.06.2022	0,00	0,000
7.322.000,00			
BPST 29.06.2022	28.06.2022	0,00	0,000
2.678.000,00			
BPST 30.06.2022	29.06.2022	0,00	0,000
9.896.000,00			
BPST 30.06.2022	29.06.2022	0,00	0,000
104.000,00			
BPST 01.07.2022	30.06.2022	0,00	0,000
3.113.000,00			
BPST 01.07.2022	30.06.2022	0,00	0,000
2.087.000,00			
BPST 01.07.2022	30.06.2022	0,00	0,000
5.000.000,00			

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	02.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	01.06.2022	13,75	56.197,000	
90.000,00							
TRPO	03.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	02.06.2022	13,55	56.058,000	
90.000,00							
TRPO	06.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	03.06.2022	0,00	55.920,000	
90.000,00							
TRPO	06.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	03.06.2022	0,00	6.213.380,000	
10.000.000,00							
TRPO	07.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	06.06.2022	0,00	55.511,000	
90.000,00							
TRPO	07.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	06.06.2022	0,00	6.167.852,000	
10.000.000,00							
TRPO	08.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	07.06.2022	13,59	61.528,000	
100.000,00							
TRPO	09.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	08.06.2022	12,03	61.379,000	
100.000,00							
TRPO	10.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	09.06.2022	13,05	61.230,000	
100.000,00							
TRPO	13.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	10.06.2022	12,45	67.190,000	
110.000,00							
TRPO	14.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	13.06.2022	13,45	72.770,000	
120.000,00							
TRPO	15.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	14.06.2022	12,33	78.645,000	
130.000,00							
TRPO	16.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	15.06.2022	12,61	78.457,000	
130.000,00							
TRPO	17.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	16.06.2022	13,05	78.270,000	
130.000,00							
TRPO	20.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	17.06.2022	13,70	84.090,000	
140.000,00							
TRPO	21.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	20.06.2022	13,02	89.457,000	
150.000,00							
TRPO	22.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	21.06.2022	0,00	95.196,000	
160.000,00							
TRPO	22.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	21.06.2022	0,00	5.949.760,000	
10.000.000,00							
TRPO	23.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	22.06.2022	0,00	5.935.740,000	
10.000.000,00							
TRPO	23.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	22.06.2022	0,00	94.972,000	
160.000,00							
TRPO	24.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	23.06.2022	13,36	94.749,000	
160.000,00							
TRPO	27.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	24.06.2022	13,61	100.435,000	
170.000,00							
TRPO	28.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	27.06.2022	13,74	105.600,000	
180.000,00							
TRPO	29.06.2022	TRT080530T19	HAZİNE	28.06.2022	12,35	111.208,000	
190.000,00							

TRPO 30.06.2022 TRT080530T19
190.000,00

HAZINE

29.06.2022

13,71

110.950,000