

ÜNLÜ Portföy Yönetimi A.Ş.
ÜNLÜ Portföy İstatistiksel Arbitraj 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 Denetim Raporu

ÜNLÜ Portföy İstatistiksel Arbitraj Serbest Fon'un 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

ÜNLÜ Portföy İstatistiksel Arbitraj Serbest Fon ("Fon")'un pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 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 ilişkin Tebliğ (II-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 2021 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

ÜNLÜ Portföy İstatistiksel Arbitraj Serbest Fon'un pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 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 ÜNLÜ Portföy Yönetimi Anonim Şirketi'nin bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka maksatla kullanılması mümkün değildir.

Güney Bağımsız Denetim ve Serbest Muhasebeci Mali Müşavirlik A.Ş.
A member firm of Ernst & Young Global Limited



Emre Celik, SMMM
Sorumlu Denetçi

22 Mart 2022

31 / 12 / 2021 Tarihli (194 UJA) Fon Toplam Değer Raporu							
	TUTARI(TL)	GRUP (%)	TOPLAM (%)		TUTARI(TL)	GRUP (%)	TOPLAM (%)
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	16.663.373,83		86,41%	FON TOPLAM DEĞERİ	19.283.207,62		
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ)	16.663.372,44		86,41%	Toplam Pay Sayısı	10.000.000.000,00		
B. HAZIR DEĞERLER	775,76		0,00%	Dolaşımdaki Pay Sayısı	17.543.694,00		
a) Kasa	0,00	0,00%	0,00%	Kurucunun Elindeki Pay Sayısı	0,00		
b) Bankalar	775,76	100,00%	0,00%	Merkezdeki Pay Sayısı	9.982.456.306,00		
i) TL Hesaplar	775,76	100,00%	0,00%	Fiyat	1,099153		
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	0,00		0,00%	(VOB AçıkPozisyon)	13.442.824,00		69,71%
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	0,00	0,00%	0,00%	Pay Sahibi Sayısı	39,00		
c) Diğer Hazır Değerler	0,00	0,00%	0,00%	Günlük Yönetim Ücreti	3.962,58		
C. ALACAKLAR	36.778.003,14		190,73%	Dünkü Fiyat	1,101880		-0.24748611%
a) Takastan Alacaklar T1	26.928.828,79	73,22%	139,65%				
b) Takastan Alacaklar T2	9.849.174,35	26,78%	51,08%				
c) Takastan BPP Alacakları	0,00	0,00%	0,00%				
d) Diğer Alacaklar	0,00	0,00%	0,00%				
D. DİĞER VARLIKLAR	0,00		0,00%				
E. BORÇLAR	34.158.945,11		-177,14%				
a) Takasa Borçlar T1	26.853.232,49	78,61%	-139,26%				
b) Takasa Borçlar T2	7.237.419,00	21,19%	-37,53%				
c) Yönetim Ücreti	46.253,10	0,14%	-0,24%				
d) Ödenecek Vergi	0,00	0,00%	0,00%				
e) İhtiyatlar	0,00	0,00%	0,00%				
f) Krediler	0,00	0,00%	0,00%				
g) Diğer Borçlar	22.040,52	0,06%	-0,11%				
i) Denetim Ücreti	11.799,84	0,03%	-0,06%				
ii) İlan Giderleri	0,00	0,00%	0,00%				
iii) Noter Masrafı	0,00	0,00%	0,00%				
iv) İhraç İzin Gideri	0,00	0,00%	0,00%				
v) Takas Saklama Komisyonu	0,00	0,00%	0,00%				
vi) Diğer	10.240,68	0,03%	-0,05%				
F. M.D.Düşüş Karşılığı	0,00		0,00%				
FON TOPLAM DEĞERİ	19.283.207,62						

31 / 12 / 2021 Tarihli (194 UJA) Fon Portföy Raporu																				
Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Deger / Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç iskonto Oranı	Borsa Sözleşme No	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	Gr up (%)	Toplam (%)	F.T.D. (%)	Depo	VKG	Stok Depo
A.HISSE SENEDİ																				
	GARANTİ BANKASI AŞ		GARAN			1.047.600,00	11,56	31/12/2021				11,27	1	11.806.452,00	0,91%	0,71%	61,23%	SRB	0	
	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş		ISGYO			49.400,00	2,99	31/12/2021				3,03	1	149.682,00	0,01%	0,01%	0,78%	SRB	0	
	ODAŞ ELEKTRİK ÜRETİM SAN TİC A.Ş.		ODAS			98.000,00	1,5	31/12/2021				1,34	1	131.320,00	0,01%	0,01%	0,68%	SRB	0	
	TORUNLAR GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.		TRGYO			218.000,00	7,6	31/12/2021				3,92	1	854.560,00	0,07%	0,05%	4,43%	SRB	0	
GRUP TOPLAMI						1.413.000,00								12.942.014,00		0,78%	67,12%			
B.BORÇLANMA SENETLERİ																				
C.KATILMA BELGESİ																				
D.OPSIYON İŞLEMLER																				
E.YABANCI HİSSE																				
F.TERS REPO																				
G.KATILIM HESABI																				
G.SATIM VAADIYLA ALIM																				
H.VADELİ MEVDUAT																				
I.KIYMETLİ MADEN																				
J.YABANCI TAHVİL																				
K.BORSA PARA PİYASASI		03/01/2022		13,95%		73.083,70	100	31/12/2021	0,00%			100,11466	1	73.083,70	1,00%	0,00%	0,38%	SRB	3	
GRUP TOPLAMI						73.083,70								73.083,70		0,00%	0,38%			
L.VARANT İŞLEMLERİ																				
M.TEMİNAT İŞLEMLERİ																				
			Teminat			3.648.276,13	1	31/12/2021				1	1	3.648.276,13	1,00%	0,22%	18,92%	VIOP TEMİNAT	0	
GRUP TOPLAMI						3.648.276,13								3.648.276,13		0,22%	18,92%			
N.SWAP																				
O.EUROBOND REPO																				
FON PORTFÖY DEĞERİ						5.134.359,83					0			16.663.373,83			86,41%		0,000132	
DÖVİZ BAKİYELERİ																				
			TRY			775,76	1	31/12/2021				1	1	775,76	1,00%	0,00%	0,00%	SRB	0	
GRUP TOPLAMI						775,76								775,76		0,00%	0,00%			
VOB SÖZLEŞMELERİ																				
	Kısa	31/01/2022	F_GARAN0122 (SHORT)			-10.476,00	12	31/12/2021				12	1	12.267.396,00	-0,91%	0,74%	-63,62%	SRB	31	
	Kısa	31/01/2022	F_ISGYO0122 (SHORT)			-494	3	31/12/2021				3	1	-154.128,00	-0,01%	0,01%	-0,80%	SRB	31	
	Kısa	31/01/2022	F_ODAS0122 (SHORT)			-980	1	30/12/2021				1	1	-136.220,00	-0,01%	0,01%	-0,71%	SRB	31	
	Kısa	31/01/2022	F_TRGYO0122 (SHORT)			-2.180,00	4	31/12/2021				4	1	-885.080,00	-0,07%	0,05%	-4,59%	SRB	31	
GRUP TOPLAMI						-14.130,00								13.442.824,00		-0,81%	69,71%			