

# Osmanlı Porftöy BIST 30 Endeksi Hisse Senedi Yoğun Borsa Yatırım Fonu

1 Ocak- 30 Haziran 2024 Dönemine Ait  
Performans Sunum Raporu



**Building a better  
working world**

Güney Bağımsız Denetim ve SMMM A.Ş.  
Maslak Mah. Eski Büyükdere Cad.  
Orjin Maslak İş Merkezi No: 27  
Daire: 57 34485 Sarıyer  
İstanbul - Türkiye

Tel: +90 212 315 3000  
Fax: +90 212 230 8291  
ey.com  
Ticaret Sicil No : 479920  
Mersis No: 0-4350-3032-6000017

## **Osmanlı Porftöy BIST 30 Hisse Senedi Yoğun Borsa Yatırım Fonu'nun yatırım performansı konusunda kamuya açıklanan bilgilere ilişkin rapor**

Osmanlı Porftöy BIST 30 Hisse Senedi Yoğun Borsa Yatırım Fonu'nun ("Fon") 1 Ocak - 30 Haziran 2024 hesap dönemine ait ekteki performans sunuş raporunu Sermaye Piyasası Kurulu'nun VII-128.5 sayılı Bireysel Portföylerin ve Kolektif Yatırım Kuruluşlarının Performans Sunumuna, Performansa Dayalı Ücretlendirilmesine ve Kolektif Yatırım Kuruluşlarını Notlandırma ve Sıralama Faaliyetlerine İlişkin Esaslar Hakkında Tebliğ'inde ("Tebliğ") yer alan performans sunuş standartlarına ilişkin düzenlemeleri çerçevesinde incelemiş bulunuyoruz.

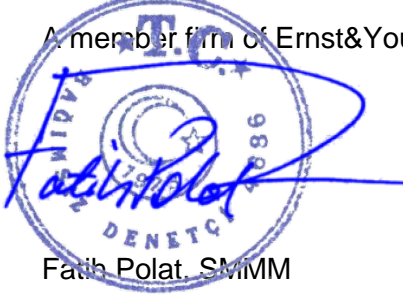
İncelememiz sonucunda Fon'un 1 Ocak - 30 Haziran 2024 hesap dönemine ait performans sunuş raporunun Tebliğ'de performans sunuş standartlarına ilişkin düzenlemelerine uygun hazırlanmadığı kanaatine varmamıza sebep olacak herhangi bir tespitimiz bulunmamaktadır.

### *Diğer Husus*

1 Ocak – 30 Haziran 2024 dönemine ait performans sunuş raporunda sunulan ve performans bilgisi hesaplamalarına dayanak teşkil eden finansal bilgiler Türkiye Bağımsız Denetim Standartları'na (BDS) uygun olarak tam veya sınırlı kapsamlı denetime tabi tutulmamıştır.

Güney Bağımsız Denetim ve Serbest Muhasebeci Mali Müşavirlik Anonim Şirketi

A member firm of Ernst&Young Global Limited



Fatih Polat, SMMM

Sorumlu Denetçi

30 Temmuz 2024

İstanbul, Türkiye

## Osmanlı Portföy BIST 30 Endeksi Hisse Senedi Yoğun Borsa Yatırım Fonu'NA AİT PERFORMANS SUNUM RAPORU

### A. TANITICI BİLGİLER

#### PORTFÖYE BAKIŞ

Halka Arz Tarihi : 26/09/2023

#### YATIRIM VE YÖNETİME İLİŞKİN BİLGİLER

28/06/2024 tarihi itibarıyla	
Fon Toplam Değeri	29.875.573
Birim Pay Değeri (TRL)	58,579555
Yatırımcı Sayısı	-
Tedavül Oranı (%)	0,00%
Portföy Dağılımı	
Ortaklık Payları	98,16%
- Bankacılık	22,38%
- Hava Yolları Ve Hizmetleri	12,91%
- Holding	10,89%
- Perakende	9,42%
- Petrol Ve Petrol Ürünleri	8,81%
- Demir, Çelik Temel	5,93%
- İletişim	5,70%
- Otomotiv	5,55%
- Cam	3,55%
- İletişim Cihazları	3,26%
- Endüstriyel Tekstil	2,28%
- İnşaat, Taahhüt	2,13%
- Elektrik	1,64%
- Tarım Kimyasalları	1,17%
- Madencilik	0,96%
- Gayrimenkul Yatırım Ort.	0,89%
- Çimento	0,69%
Teminat	1,84%
Toplam	100,00%

Fon'un Yatırım Amacı	Portföy Yöneticileri
-Fon BIST 30 Ağırlıklı Sınırlı 25 Getiri Endeksini takip etmektedir. -Endeks yapıcısı Borsa İstanbul A.Ş. dir.-Takip hatasının ..../20...-.../.../20.... arası normal piyasa koşulları altında öngörülen tahmini değeri %5 tir. -Takip farkı ile takip hatasının büyüklüğünü etkileyen faktörler aşağıda yer almaktadır:a)Fonda takip edilen endeks kapsamındaki hisse senetlerinin taşınma oranıb)Toplam Giderler ve İşlem MaliyetleriTemettü ödemeleriPiyasa likiditesi sonucu ortaya çıkan fiyatlamalaraEndeks içerik değişiklikleri ve endeks şirketlerindeki hak kullanımları (birleşme/bölünme/sermaye değişiklikleri vb.)-Fon, Fon Toplam Değeri'nin en az %80'ini devamlı olarak sadece takip edilen endeks kapsamındaki varlıklara yatırım yapmak suretiyle endeksi takip eder.	Can Tuğrul Kıyıcı Mehmet Taylan Tatlısu
En Az Alınabilir Pay Adedi : 0.000000 Adet	
Yatırım Stratejisi	
Fonun temel stratejisi, takip edilen endeksin performansını yansıtmaktır. Bunun ölçümü, takip farkı ve takip hatasının izahnamede yer verilen şekilde hesaplanması suretiyle yapılır.	
Yatırım Riskleri	

## B. PERFORMANS BİLGİSİ

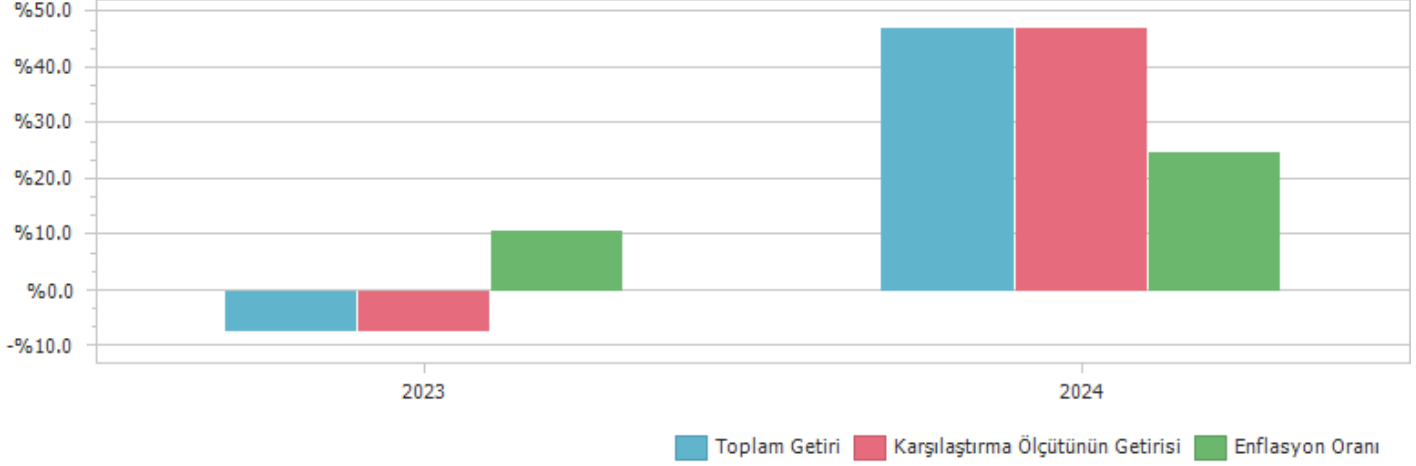
PERFORMANS BİLGİSİ							
YILLAR	Toplam Getiri (%)	Karşılaştırma Ölçütünün Getirisi (%)	Enflasyon Oranı (%) (TÜFE) (*)	Portföyün Zaman İçinde Standart Sapması (%) (**)	Karşılaştırma Ölçütünün Standart Sapması (%) (**)	Bilgi Rasyosu	Sunuma Dahil Dönem Sonu Portföyün Toplam Değeri / Net Aktif Değeri
2023	-7,237%	-7,357%	10,638%	1,928%	1,9513%	0,0339	20.335.863,21
2024 (***)	46,911%	46,988%	24,735%	1,448%	1,4553%	-0,0039	29.875.572,83

(\*) Enflasyon oranı TÜİK tarafından açıklanan 12 aylık TÜFE'nin dönemsel oranıdır.

(\*\*) Portföyün ve karşılaştırma ölçütünün standart sapması dönemdeki günlük getiriler üzerinden hesaplanmıştır.

(\*\*\*) İlgili veriler sene başından itibaren rapor tarihine kadar olan değerleri vermektedir.

### PERFORMANS GRAFİĞİ



**GEÇMİŞ GETİRİLER GELECEK DÖNEM PERFORMANSI İÇİN BİR GÖSTERGE SAYILMAZ.**

### C. DİPNOTLAR

1) Osmanlı Portföy Yönetimi A.Ş.("Şirket") 05.03.2015 tarihinde İstanbul' da kurulup tescil edilmiş bir sermaye şirkettir. Osmanlı Yatırım Menkul Değerler A.Ş.'nin %100 oranında bağlı ortağıdır. Şirket' in ana faaliyet konusu SPK'n ve ilgili mevzuat hükümleri çerçevesinde yatırım fonlarının kurulması ve yönetimidir. Ayrıca, yatırım ortaklarının, 28.03.2001 tarihli ve 4632 sayılı Bireysel Emeklilik Tasarruf ve Yatırım Sistemi Kanunu kapsamında kurulan emeklilik yatırım fonlarının ve bunların muadili yurt dışında kurulmuş yabancı kolektif yatırım kuruluşlarının portföylerinin yönetimi de ana faaliyet konusu kapsamındadır. Şirket, sermaye piyasası mevzuatında yer alan şartları sağlamak ve Sermaye Piyasası Kurulu'ndan gerekli izin ve/veya yetki belgelerini almak kaydıyla, portföy yöneticiliği, yatırım danışmanlığı ve kurucusu olduğu yatırım fonlarının katılma payları dahil olmak üzere fon katılma payları ile değişken sermayeli yatırım ortaklıklarının paylarının pazarlanması ve dağıtılması faaliyetinde bulunabilir. Kolektif yatırım kuruluşlarının portföy yönetimi hizmeti kapsamında 28.06.2024 Tarihi itibarıyla 4 adet Emeklilik Yatırım fonu, 1 adet Borsa Yatırım Fonu, 17 Adet Yatırım Fonu portföyü yönetmektedir. Toplam Yönetilen varlık büyüklüğü 28.06.2024 tarihi itibarıyla 3,736,056,974.66 TL'dir.

2) Fon Portföyü'nün yatırım amacı, yatırımcı riskleri ve stratejisi "Tanıtıcı Bilgiler" bölümünde belirtilmiştir.

3) Fon 01/01/2024 - 28/06/2024 döneminde net %46.91 oranında getiri sağlarken, karşılaştırma ölçütünün getirisini aynı dönemde %46.99 olmuştur. Sonuç olarak Fon'un nispi getirisi %-0.08 olarak gerçekleşmiştir.

Toplam Getiri : Fonun ilgili dönemdeki birim pay değerindeki yüzdesel getiriyi ifade etmektedir.

Karşılaştırma Ölçütünün Getirisini : Fonun karşılaştırma ölçütünün ilgili dönem içerisinde belirtilen varlık dağılımları ile ağırlıklandırarak hesaplanmış olan yüzdesel getirisini ifade etmektedir.

Nispi Getiri : Performans sonu dönemi itibarıyla hesaplanan portföy getiri oranı ile karşılaştırma ölçütünün getiri oranı arasındaki farkı ifade etmektedir.

4) Yönetim ücretleri, vergi, saklama ücretleri ve diğer faaliyet giderlerinin günlük brüt portföy değerine oranının ağırlıklı ortalaması aşağıdaki gibidir.

01/01/2024 - 28/06/2024 döneminde :	Portföy Değerine Oranı (%)	TL Tutar
Fon Yönetim Ücreti	0,000679%	32.324,78
Denetim Ücreti Giderleri	0,003288%	156.565,00
Saklama Ücreti Giderleri	0,000377%	17.950,78
Aracılık Komisyonu Giderleri	0,000047%	2.244,46
Kurul Kayıt Ücreti	0,000058%	2.749,25
Diğer Faaliyet Giderleri	0,000120%	5.067,51
Toplam Faaliyet Giderleri		216.901,78
Ortalama Fon Portföy Değeri		26.160.753,66
Toplam Faaliyet Giderleri / Ortalama Fon Portföy Değeri		0,829111%

5) Performans sunum döneminde Fon'a ilişkin yatırım stratejisi değişikliği yapılmamıştır.

Kıstas Dönemi	Kıstas Bilgisi
25/09/2023-...	%100 BIST 30 AĞIRLIK SINIRLAMALI 25 GETİRİ

## D. İLAVE BİLGİLER VE AÇIKLAMALAR

1) Tüm dönemler için portföy ve karşılaştırma ölçütünün birikimli getiri oranı

Dönemler	Portföy Net Getiri	Portföy Brüt Getiri	Karşılaştırma Ölçütü	Nispi Getiri
26/09/2023 - 29/12/2023	-6,49%	-6,43%	-6,61%	0,12%
02/01/2024 - 28/06/2024	46,91%	47,09%	46,99%	-0,08%

2) Döviz Kurlarındaki Dönemsel Ortalama Getiri ve Sapma

Dönemler	USD		EUR		GBP		JPY	
	Ortalama	Standart Sapma	Ortalama	Standart Sapma	Ortalama	Standart Sapma	Ortalama	Standart Sapma
26/09/2023 - 29/12/2023	0,12%	0,10%	0,17%	0,45%	0,18%	0,50%	0,19%	0,61%
02/01/2024 - 28/06/2024	0,09%	0,27%	0,06%	0,38%	0,08%	0,43%	-0,01%	0,50%

3) Portföy ve Karşılaştırma Ölçütü / Eşik Değeri için Risk Ölçümleri

Dönemler	Takip Hatası	Beta
26/09/2023 - 29/12/2023	0,0067	0,9881
02/01/2024 - 28/06/2024	0,0217	0,9903

29/12/2023 - 28/06/2024 Dönem Getirisi	Getiri
BIST 100 ENDEKSİ	45,05%
BIST 30 ENDEKSİ	46,99%
BIST-KYD REPO BRÜT ENDEKSİ	27,08%
BIST-KYD DİBS 91 GÜN ENDEKSİ	18,27%
BIST-KYD DİBS 182 GÜN ENDEKSİ	18,74%
BIST-KYD DİBS 365 GÜN ENDEKSİ	17,10%
BIST-KYD DİBS 547 GÜN ENDEKSİ	14,26%
BIST-KYD DİBS TÜM ENDEKSİ	6,87%
BIST-KYD DİBS UZUN ENDEKSİ	3,82%
BIST-KYD ÖSBA SABİT ENDEKSİ	22,89%
BIST-KYD ÖSBA DEĞİŞKEN ENDEKSİ	27,64%
BIST-KYD Kamu Kira Sertifikaları Endeksi	12,26%
BIST-KYD Özel Sektör Kira Sertifikaları Endeksi	21,52%
BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Mevduat Endeksi (TL)	27,41%
BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Kar Payı TL Endeksi	17,18%
BIST Katılım 50 GETİRİ ENDEKSİ	33,81%
BIST-KYD ALTIN FİYAT AĞIRLIKLILIKLI ORTALAMA	25,05%
BIST-KYD Eurobond USD (TL)	14,38%
BIST-KYD Eurobond EUR (TL)	10,53%
Dolar Kuru	11,51%
Euro Kuru	7,84%

	OHY
Net Basit Getiri	46,91%
Gerçekleşen Fon Toplam Giderleri Oranı	1,58%
Azami Toplam Gider Oranı	2,19%
Kurucu Tarafından Karşılana Giderlerin Oranı	0,00%
Net Gider Oranı	1,58%
Brüt Getiri	48,49%