

Ata Portföy Algoritmik Stratejiler Serbest (TL) 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 Bağımsız Denetçi Raporu

Ata Portföy Algoritmik Stratejiler Serbest (TL) 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 Algoritmik Stratejiler Serbest (TL) Fonu'nun pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 31 Aralık 2024 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 2024 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Ata Portföy Algoritmik Stratejiler Serbest (TL) Fonu'nun pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 31 Aralık 2024 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, 27.03.2025
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 07230 - 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) 282 83 22
gymtrakya@gureli.com.tr

ATA PORTFÖY ALGORİTMİK STRATEJİLER SERBEST (TL) FON

31 Aralık 2024 Tarihli
Fiyat Raporu Tablosu EK-1[illegible]

ATA PORTFÖY ALGORİTMİK STRATEJİLER SERBEST TULİON

31 Aralık 2023 Tarihli

Fiyat Farkına Tabii (FCI) (p)

Sermaye Piyasası Aracı	İşleşiği	Vade	İşin Kodu	Nominal Fiyat Oranı	Vadeye Kalan Gün	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Borsa Sözleşme No	Günlük Birim Değer	Toplam Değer/Net Varlık Değer	Grup (%)	Toplam (%)
A. HİSSE SERİDİ	ARBANK T.A.Ş. ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş. TÜRKİYE GARANTİ BANKASI A.Ş. T. HALK BANKASI A.Ş. İŞ BANKASI Ç KREDİT PEŞİSUS SABANCI HOLDİNG A.Ş. TÜRKİYE ŞİŞ VE CAM FABRİKALARI A.Ş. ŞOK MARKETLERİ TİCARET A.Ş. TÜRKCELL İLETİŞİM HİZ. A.Ş. TÜRK HAVA YOLLARI A.Ş. TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş. TÜRKİYE VAKIFLARI BANKASI T.A.Ş. VAPİVE BREDİ BANKASI A.Ş.	27.02.2024 02.01.2024	ARBANK ASELS GARAN HALKB ISCTR KREDMD PESSUS SABHOL SISE SOKM TCELL THYAO TTKOM VAKBN YBNBK	46,00 41,00	57 1		80,243	37,403662	27.12.2023			36,52	2,930,474	15,95	2,87
							20,195	45,056685	27.12.2023			44,98	908,371	0,89	
							15,862	58,332143	27.12.2023			58,35	925,548	5,04	
							145,939	11,721248	27.12.2023			11,98	1,748,349	9,52	
							120,473	22,874544	27.12.2023			23,36	2,814,249	15,32	
							249	24,874794	01.12.2023			23,76	5,916	0,03	
							1,500	659,274285	28.12.2023			649,5	974,250	5,3	
							37,259	60,776966	27.12.2023			60,45	2,252,307	5,3	
							38,778	46,040153	27.12.2023			45,82	1,774,517	12,26	
							5,000	62,46097	04.12.2023			53,95	269,750	9,66	
							10,000	56,1	29.12.2023			56,1	561,000	1,47	
							3,100	227,77046	27.12.2023			228,6	708,660	3,05	
							4,535	24,503571	27.12.2023			24,36	110,473	0,6	
							115,757	14,562803	27.12.2023			12,84	1,486,320	8,09	
46,198	19,188318	29.12.2023	19,54	902,709	0,88										
							645,038					18,372,893		18,00	
							645,038						18,372,893		
FOR PORTFÖY DİĞERİ															
VADEJİ TL MEVDUATI															
GRUP TOPLAMI							25,000,000 48,108,298 73,108,298	100 100	27.11.2023 29.12.2023	0,00 0,00		104,386146 100,449315	26,096,536 48,324,455 74,420,992	35,07 64,35	25,57 47,35 72,92
B. TEMİNAT İŞLEMLERİ															
GRUP TOPLAMI							9,260,587 9,260,587	1 1	29.12.2023			1	9,260,587 9,260,587	100 9,07	9,07
C. VOB SÖZLEŞMELERİ															
GRUP TOPLAMI							(779) (196) (154) (1,415) (1,156) (1,246) (1,76) (46) (44) (1,139)	39,63453 46,878602 60,786494 12,200912 23,886523 64,386439 47,969495 236,954333 25,519545 13,427703	25.12.2023 25.12.2023 25.12.2023 25.12.2023 25.12.2023 25.12.2023 25.12.2023 25.12.2023 25.12.2023 25.12.2023		37,81 46,02 60,19 12,39 24,11 62,62 47,57 236,41 25,03 13,35	(2,945,399) (901,992) (926,926) (1,753,185) (2,791,938) (1,653,168) (1,788,632) (176,120) (143,865) (9,35)	(18,43) (88) (580) (10,97) (17,47) (10,35) (11,19) (4,44) (11) (69)	(2,89) (88) (91) (10,97) (17,47) (1,62) (11,19) (4,44) (11) (69)	
GRUP TOPLAMI							(5,982)					20,21	(15,977,894)		(15,66)

ATA PORTFÖY ALGORİTMİK STRATEJİLER SERBEST (TL) FON

31 Aralık 2024 Tarihli

Fiyat Raporu Tablosu EK-1 (b)

	31 Aralık 2024			31 Aralık 2023		
	TUTARI (TL)	GRUP %	TOPLAM %	TUTARI (TL)	GRUP %	TOPLAM %
A.FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ	1.043.864	100,00	0,26	18.372.893	100,00	14,30
B. HAZIR DEĞERLER (+)	77.705.276	100,00	19,00	83.681.579	100,00	65,13
a) Kasa	-	-	-	-	-	-
b) Bankalar	50.132.514	64,52	12,26	74.420.992	88,93	57,92
c) Diğer Hazır Değerler	27.572.762	35,48	6,74	9.260.587	11,07	7,21
	-	-	-	-	-	-
C.ALACAKLAR (+)	335.517.900	100,00	82,05	31.272.479	100,00	24,34
a) Takastan Alacaklar	134.981.462	40,23	33,01	31.272.479	100,00	24,34
b) Diğer Alacaklar	-	-	-	-	-	-
C) Ters Repo Alacakları	200.536.438	59,77	49,04	-	-	-
Ç. DİĞER VARLIKLAR (+)	-	-	-	-	-	-
D. BORÇLAR (-)	5.347.612	100,00	1,31	4.844.207	100,00	3,77
a) Takasa Borçlar	4.731.425	88,48	1,16	4.575.600	94,46	3,56
b) Yönetim Ücreti	497.569	9,30	-	205.422	4,24	-
c) Ödenecek Vergi	-	-	-	-	-	-
ç) İhtiyatlar	-	-	-	-	-	-
d) Krediler	-	-	-	-	-	-
e) Diğer Borçlar	98.170	1,84	0,02	56.760	1,17	0,04
f) Denetim Ücretleri	-	-	-	-	-	-
f) Kayda Alma Ücretleri	20.448	0,38	-	6.425	0,13	-
TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	408.919.429		100,00	128.482.744		100,00
Toplam Katılma Payı/Pay Sayısı	408.919.429			128.482.744		
Yatırım Fonları İçin Kurucu Tarafından İktisap Edilen Katılma Payı	99.782.797.181			99.889.754.475		
Dolaşımdaki Pay Sayısı	217.202.819			110.245.525		
Birim Pay Değeri	1,882662			1,165424		