

NUROL PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ HİSSE SENEDİ SERBEST FON (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON)
(NSH)
01/02/2025 - 28/02/2025 TARİHLERİ ARASI FON RAPORU

I-FONU TANITICI BİLGİLER

A-FONUN ADI	NUROL PORTFÖY İSTATİSTİKSEL ARBİTRAJ HİSSE
B-KURUCUNUN UNVANI	NUROL PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C-YöNETİCİNİN UNVANI	NUROL PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
Ç-FON TUTARI	1.000.000.000
D-TOPLAM DEGER	223.948.793,74000000
E-KATILMA PAYI SAYISI	179.927.749
F-FONUN KURULUSU TARİHİ	23/07/2023
G-FONUN SURESİ	SÜRESİZ

II-FONUN PERFORMANSINA İLİSKİN ÖZEL BİLGİLER

A- AY SONU KATILMA PAY FİYATI (28/02/2025)	1,244352
B- ONCEKI AY KATILMA PAY FİYATI (31/01/2025)	1,210602
C- AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI (31/01/2025-28/02/2025)	2.79%
Ç- YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI (01/01/2025-28/02/2025)	6.50%
D- YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI(28/02/2024-28/02/2025)	24.44%
E- AYLIK ORT. PORTFOYDEKİ MENK.KIY. YUZDESİ	
---Hisse Senedi	79.27%
---T.Repo	-0.69%
---Swap	0.00%
---Viop Teminat	21.41%
F- AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	18.55%
G- AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
---Hisse Senedi	424.28%
---T.Repo	1,206.36%
---Swap	0.00%
---Viop Teminat	2,800.00%
Ğ- PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	0,85
H- KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	59.023.710,93
I- KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	43.427.946,55

III-FON PORTFOY DEGERİ TABLOSU

Sermaye Piyasası Araçları	İhraccı	İsın Kodu	Nominal Değeri	Toplam Değer	Grup(%)	Toplam(%)
A.Pay						
AEFES ANADOLU EFES BİRACILIK V	TRAAEFES91A9	125,000	21.600,00	0,01	0,01	
AKBNK AKBANK T.A.Ş.	TRAAKBNK91N6	37,000	2.490,10	0,00	0,00	
AKSEN AKSA ENERJİ ÜRETİM A.Ş.	TREAKSN00011	36.007,000	1.272.487,38	0,69	0,56	
ALARK ALARKO HOLDİNG A.Ş.	TRAALARK91Q0	522,000	39.776,40	0,02	0,02	
ARCLK ARÇELİK A.Ş.	TRAARCLK91H5	99,000	12.632,40	0,01	0,01	
ASTOR ASTOR ENERJİ A.Ş.	TREASTR00013	62,000	6.776,60	0,00	0,00	
BIMAS BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A	TREBIMM00018	73,000	36.938,00	0,02	0,02	
BRSAN BORUSAN BİRLEŞİK BORU F	TRABRSAN91G8	300,000	107.025,00	0,06	0,05	
BRSAN BORUSAN BİRLEŞİK BORU F	TRABRSAN91G8	167,000	59.577,25	0,03	0,03	
CIMSA ÇİMSA ÇİMENTO SANAYİ VE	TRACIMSA91F9	271.800,000	12.236.436,00	6,60	5,37	
CIMSA ÇİMSA ÇİMENTO SANAYİ VE	TRACIMSA91F9	1.921,000	86.483,42	0,05	0,04	
DOHOL DOĞAN ŞİRKETLER GRUBU	TRADOHOL91Q8	1.088.500,000	14.215.810,00	7,67	6,24	
DOHOL DOĞAN ŞİRKETLER GRUBU	TRADOHOL91Q8	50.300,000	656.918,00	0,35	0,29	
EKGYO EMLAK KONUT GAYRİMENKİ	TREEGYO00017	1.550.094,000	22.321.353,60	12,04	9,79	
ENJSA Enerjisa Elektrik Dağıtım A.Ş.	TREENSA00014	177.800,000	10.321.290,00	5,57	4,53	
ENJSA Enerjisa Elektrik Dağıtım A.Ş.	TREENSA00014	14.068,000	816.647,40	0,44	0,36	

ENKAI ENKA İNŞAAT VE SANAYİ A.Ş	TREENKA00011	3.500,000	170.030,00	0,09	0,07
ENKAI ENKA İNŞAAT VE SANAYİ A.Ş	TREENKA00011	35,000	1.700,30	0,00	0,00
EREGL EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FAİ	TRAEREGL91G3	3.300,000	73.656,00	0,04	0,03
FROTO FORD OTOMOTİV SANAYİ A.	TRAOTOSN91H6	3,000	2.647,50	0,00	0,00
GARAN TÜRKİYE GARANTİ BANKASI	TRAGARAN91N1	752,000	96.782,40	0,05	0,04
GUBRF GÜBRE FABRİKALARI T.A.Ş.	TRAGUBRF91E2	36.644,000	10.113.744,00	5,46	4,44
HALKB TÜRKİYE HALK BANKASI A.Ş	TRETHAL00019	474.700,000	9.313.614,00	5,02	4,09
HALKB TÜRKİYE HALK BANKASI A.Ş	TRETHAL00019	23.370,000	458.519,40	0,25	0,20
HEKTS HEKTAŞ TİCARET T.A.Ş.	TRAHEKTS91E4	9.590,000	31.838,80	0,02	0,01
ISCTR TÜRKİYE İŞ BANKASI A.Ş.	TRAISCTR91N2	75,000	1.137,75	0,00	0,00
KCHOL KOÇ HOLDİNG A.Ş.	TRAKCHOL91Q8	16.758,000	2.553.919,20	1,38	1,12
KONTR KONTROLMATİK TEKNOLOJİ	TREKNTR00013	1.008,000	30.240,00	0,02	0,01
KOZAA KOZA ANADOLU METAL MAİ	TREKOZA00014	262.337,000	17.537.228,45	9,46	7,69
KOZAL KOZA ALTIN İŞLETMELERİ A	TREKOAL00014	77,000	1.724,80	0,00	0,00
KRDMD KARDEMİR KARABÜK DEMİR	TRAKRDMR91G7	4.588,000	127.087,60	0,07	0,06
MGROS MİGROS TİCARET A.Ş.	TREMGTI00012	45,000	25.290,00	0,01	0,01
ODAS ODAŞ ELEKTRİK ÜRETİM SA	TREODAS00014	826.300,000	4.313.286,00	2,33	1,89
ODAS ODAŞ ELEKTRİK ÜRETİM SA	TREODAS00014	907.378,000	4.736.513,16	2,55	2,08
OYAKC OYAK ÇİMENTO FABRİKALAI	TRAMRDIN91F2	386,100	10.733,58	0,01	0,00
PETKM PETKİM PETROKİMYA HOLD	TRAPETKM91E0	17.137,000	279.675,84	0,15	0,12
PGSUS PEGASUS HAVA TAŞIMACILI	TREPEGS00016	3.082,000	736.598,00	0,40	0,32
SAHOL HACI ÖMER SABANCI HOLDİ	TRASAHOL91Q5	46.052,000	4.457.833,60	2,40	1,96
SASA SASA POLYESTER SANAYİ A	TRASASAW91E4	10.200,000	36.006,00	0,02	0,02
SISE TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABF	TRASISEW91Q3	3.796,000	134.606,16	0,07	0,06
SOKM ŞOK MARKETLER TİCARET A	TRESOKM00022	71.700,000	2.733.204,00	1,47	1,20
SOKM ŞOK MARKETLER TİCARET A	TRESOKM00022	87,000	3.316,44	0,00	0,00
TAVHL TAV HAVALİMANLARI HOLDİ	TRETAVH00018	40.693,000	10.148.834,20	5,47	4,45
TCELL TURKCELL İLETİŞİM HİZMET	TRATCELL91M1	11.844,000	1.192.690,80	0,64	0,52
THYAO TÜRK HAVA YOLLARI A.O.	TRATHYAO91M5	47.739,000	14.715.546,75	7,94	6,45
TKFEN TEKFEN HOLDİNG A.Ş.	TRETKHO00012	9.592,000	675.276,80	0,36	0,30
TOASO TOFAŞ TÜRK OTOMOBİL FAİ	TRATOASO91H3	66,000	12.870,00	0,01	0,01
TSKB TÜRKİYE SINAI KALKINMA B	TRATSKBW91N0	542.200,000	6.696.170,00	3,61	2,94
TSKB TÜRKİYE SINAI KALKINMA B	TRATSKBW91N0	1.526.807,000	18.856.066,45	10,17	8,27
TTKOM TÜRK TELEKOMÜNİKASYON	TRETTTLK00013	1.153,000	55.574,60	0,03	0,02
TUPRS TUPRAŞ-TÜRKİYE PETROL F	TRATUPRS91E8	350,000	45.150,00	0,02	0,02
ULKER ÜLKER BİSKÜVİ SANAYİ A.Ş.	TREULKR00015	30.161,000	3.329.774,40	1,80	1,46
VAKBN TÜRKİYE VAKIFLAR BANKA	TREVKFB00019	187.682,000	4.860.963,80	2,62	2,13
VESTL VESTEL ELEKTRONİK SANA	TRAVESTL91H6	61.745,000	3.454.632,75	1,86	1,52
YKBNK YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş	TRAYKBNK91N6	39.350,000	1.156.890,00	0,62	0,51
A.Grup Toplam		8.414.157,100	185.395.615,08	81,32	81,32

Ç.Türev Araçlar
VOB

VOB	F_AKSEN0325	-351,000	0,00	0,00	0,00
VOB	F_BRSAN0325	-1,000	0,00	0,00	0,00
VOB	F_CIMSA0325	-2.728,000	0,00	0,00	0,00
VOB	F_DOHOL0325	-11.312,000	0,00	0,00	0,00
VOB	F_EKGYO0325	-15.552,000	0,00	0,00	0,00
VOB	F_ENJSA0325	-1.941,000	0,00	0,00	0,00
VOB	F_ENKAI0325	-35,000	0,00	0,00	0,00
VOB	F_GUBRF0325	-369,000	0,00	0,00	0,00
VOB	F_HALKB0325	-4.954,000	0,00	0,00	0,00
VOB	F_KCHOL0325	-166,000	0,00	0,00	0,00
VOB	F_KOZAA0325	-2.612,000	0,00	0,00	0,00
VOB	F_ODAS0325	-17.235,000	0,00	0,00	0,00
VOB	F_PETKM0325	-50,000	0,00	0,00	0,00
VOB	F_PGSUS0325	-28,000	0,00	0,00	0,00
VOB	F_SAHOL0325	-461,000	0,00	0,00	0,00
VOB	F_SOKM0325	-689,000	0,00	0,00	0,00
VOB	F_TAVHL0325	-409,000	0,00	0,00	0,00
VOB	F_TCELL0325	-113,000	0,00	0,00	0,00
VOB	F_THYAO0325	-479,000	0,00	0,00	0,00
VOB	F_TKFEN0325	-90,000	0,00	0,00	0,00

	VOB	F_TSKB0325	-20.622,000	0,00	0,00	0,00
	VOB	F_ULKER0325	-290,000	0,00	0,00	0,00
	VOB	F_VAKBN0325	-1.802,000	0,00	0,00	0,00
	VOB	F_VESTL0325	-611,000	0,00	0,00	0,00
	VOB	F_YKBNK0325	-400,000	0,00	0,00	0,00
	VOB Toplam		-83.300,000	0,00	0,00	0,00
	VIOP					
	VIOP	Viop Teminat	42.584.968,080	42.584.968,08	100,00	18,68
	VIOP Toplam		42.584.968,080	42.584.968,08	18,68	18,68
	Ç.Grup Toplam		42.501.668,080	42.584.968,08	18,68	18,68
	Fon Portföy Değeri		50.915.825,180	227.980.583,16		

IV-FON TOPLAM DEGER TABLOSU

	Tutar TL	Grup %	Toplam %
A- FON PORTFOY DEGERI	227.980.583,16	0,00	101,80
B- HAZIR DEGERLER (+)	58.923,54	0,00	0,03
a- Kasa	0,00	0,00	0,00
b- Bankalar	58.923,54	100,00	0,03
c- Diğer Hazır Değerler	0,00	0,00	0,00
C- ALACAKLAR (+)	334.868.320,25	0,00	149,53
a- Takastan Alacaklar	334.868.320,25	100,00	149,53
b- Diğer Alacaklar	0,00	0,00	0,00
c- Diğer Varlıklar	0,00	0,00	0,00
D- BORÇLAR (-)	338.959.033,21	0,00	151,36
a- Takasa Borclar	337.336.471,36	99,52	150,63
b- Yönetim Ücreti	732.861,76	0,22	0,33
c- Ödenecek Vergi	0,00	0,00	0,00
d- İhtiyatlar	0,00	0,00	0,00
e- Krediler	0,00	0,00	0,00
f- Diğer Borçlar	889.700,09	0,26	0,40
FON TOPLAM DEĞERİ	223.948.793,74	0,00	100,00
Toplam Pay Sayısı	1.000.000.000,000	0,00	100,00
Dolaşımdaki Pay Sayısı	179.927.749,000	0,00	17,99
Satılabilir Pay Sayısı	820.072.251,000	0,00	82,01
Kurucunun Elindeki Pay Sayısı	0,000	0,00	0,00
Pay Değer	1,244660	0,00	0,00
Müşteri Sayısı	304,00	0,00	0,00
Günlük Fon Yönetim Ücreti	25.769,47	0,00	0,00
Önceki Fiyat	1,24	0,00	0,00
Getiri (%)	0,02	0,00	0,00

V-01/02/2025 - 28/02/2025 TARİHLERİ ARASI YAPILAN GİDERLER

YONETIM UCRETI	732.861,76
HISSE SENEDI	138.045,53
O/N REPO PIYASASINA SATIŞ	51,20
VADELİ REPO PİYASASINA SATIŞ	295,32
VOB	260.670,56
PORTFOY SAKLAMA GIDER TAHAKKUKU	38.507,99
KAP HIZMET BEDELİ TAHAKKUKU	2.436,00
TAKASBANK KOMİSYONLARI	4.325,63
BAGIMSIZ DENETİM GİDER TAHAKKUKU	3.640,00
ARACILIK KOMİSYON GİDERLERİ	509,44
NOTER VE HUKUK GİDERLERİ	2.039,24
E-defter/E-fatura Gideri	3.360,00
ENDEKS GİDERİ	5.040,00
MKYF-TL Kasa Netleşmesi(Gider)	322,45

Diğer Giderler	1,86
KURUMLAR VERGİSİ	443,70
ÖDENECEK SPK KURUL KAYIT ÜCRETİ	3.848,01
TOPLAM	1.196.398,69

VI- A- GECEN AY ICINDE RUCHAN HAKKI KULLANIMI,BEDELSİZ HISSE SENEDI ALIMİ, □

□TEMETTU KULLANIMI VE ANA PARA TAHSILATINA ILISKIN ACIKLAMALAR

B- GEÇEN AY İÇİNDE YATIRIM FONLARINA İLİŞKİN MEVZUATTA MEYDANA GELEN DEĞİŞME VE

□HUKUKİ İHTİLAFLARLA İLGİLİ AÇIKLAMALAR