

Yatırımcı Bilgi Formu

Bu form, bu Fon ile ilgili temel bilgileri ve Fon'a yatırım yapmaktan kaynaklanan riskleri içerecek şekilde sermaye piyasası mevzuatı uyarınca hazırlanmıştır. Bu form, bir satış ya da pazarlama dokümanı değildir. Fon hakkındaki temel bilgileri edinmek ve fona ilişkin temel riskleri anlayabilmek için Fon'a yatırım yapmaya karar vermeden önce bu formu okumanız tavsiye edilir.

Nurol Portföy İstatistiksel Arbitraj Hisse Senedi Serbest Fon (Hisse Senedi Yoğun Fon)

ISIN KODU:

İhraç tarihi:

Fon Hakkında

Bu fon, Nurol Portföy Yönetimi A.Ş. Serbest Şemsiye Fonu'na bağlı serbest fondur ve bu formda belirlenen risk profilindeki yatırımcılara yöneliktir. Fon portföyü Nurol Portföy Yönetimi A.Ş. tarafından yönetilmektedir. Nurol Portföy Yönetimi A.Ş. , Nurol Yatırım Bankası A.Ş. 'nin iştirakidir.

Yatırım Amacı ve Politikası

- Fon'un ana yatırım stratejisi uyarınca, BIST'te işlem gören; ortaklık paylarında, ortaklık paylarına ait rüçhanlarda, varantlarda, vadeli işlem sözleşmeleri, opsiyon sözleşmeleri ve diğer türev araçlarda gün içinde gerçekleşebilecek fiyat uyuşmazlıklarını ve istatistiksel arbitraj fırsatlarını algoritma destekli sistemler ile değerlendirerek sermaye kazancı sağlamak ve portföy değerini artırmaktır. Fon, söz konusu yatırım stratejisi sonucu oluşan pozisyon risklerini uygun görülen yüksek korelasyonlu yurt içi ve yurt dışı finansal ürünler yardımıyla hedge etmeyi amaçlamaktadır.

- Fon'un hisse senedi yoğun fon olması nedeniyle Fon portföy değerinin en az %80'i devamlı olarak menkul kıymet yatırım ortaklıkları payları hariç olmak üzere BIST'te işlem gören ihraççı payları, ihraççı paylarına ve ihraççı payı endekslerine dayalı olarak yapılan vadeli işlem sözleşmelerinin nakit teminatları, ihraççı paylarına ve pay endekslerine dayalı opsiyon sözleşmelerinin primleri, borsada işlem gören ihraççı paylarına ve pay endekslerine dayalı aracı kuruluş varantları ile en az %80'i devamlı olarak menkul kıymet yatırım ortaklıkları payları hariç olmak üzere BIST'te işlem gören ihraççı paylarından oluşan endeksleri takip etmek üzere kurulan borsa yatırım fonu katılma paylarına yatırılır.

-Fonun eşik değeri %100 BIST-KYD 1 Aylık Mevduat TL Endeksi olacaktır.

-Portföye riskten korunma ve/veya yatırım amacıyla fonun yatırım stratejisine uygun olacak şekilde kaldıraç yaratan işlemlerden; koruma ve yatırım amaçlı türev araç (vadeli işlem ve opsiyon sözleşmeleri), saklı türev araç, swap sözleşmesi, varant, sertifika, ileri valörlü tahvil/bono, altın ve diğer kıymetli madenler ile bu kıymetli madenlere dayalı opsiyon, forward/futures finansal vadeli işlem sözleşmeleri, swap ve benzeri türev araçlarına ve diğer herhangi bir yöntemle kaldıraç yaratan benzeri işlemler dahil edilebilir. Ortaklık

payları, özel sektör ve kamu borçlanma araçları, altın ve diğer kıymetli madenler, faiz, döviz/kur ve finansal endekslere dayalı türev araçlara, varantlara ve sertifikalara yatırım yapılabilir.

-Yatırım yapılacak varlıkların belirlenmesinde Nurol Portföy Yönetimi A.Ş. yetkilidir.

Portföy Dağılımı

Henüz portföy dağılım bilgisi bulunmamaktadır.

Alım Satım ve Vergileme Esasları

-Fon katılma payları her iş günü sonu itibariyle Finansal Raporlama Tebliği'nde belirlenen ilkeler çerçevesinde hesaplanan fiyat üzerinden alınıp satılır.

-Fon katılma payı alım satımının yapılacağı para birimi TL'dir.

-Yatırımcıların BIST Pay Piyasası'nın açık olduğu günlerde saat 13:30'a kadar verdikleri katılma payı alım ve satım talimatları, talimatın verilmesini takip eden ilk hesaplamada bulunacak pay fiyatı üzerinden yerine getirilir. BIST Pay Piyasası'nın açık olduğu günlerde saat 13:30'dan sonra iletilen talimatlar ise, ilk pay fiyatı hesaplamasından sonra verilmiş olarak kabul edilir ve izleyen hesaplamada bulunan pay fiyatı üzerinden yerine getirilir. BIST Pay Piyasası'nın kapalı olduğu günlerde iletilen talimatlar, izleyen ilk iş günü yapılacak ilk hesaplamada bulunacak pay fiyatı üzerinden gerçekleştirilir.

-Katılma payı satım bedelleri; iade talimatının, BIST Pay Piyasası'nın açık olduğu günlerde saat 13:30'a kadar verilmesi halinde, talimatın verilmesini takip eden ikinci işlem gününde, iade talimatının BIST Pay Piyasası'nın açık olduğu günlerde saat 13:30'dan sonra verilmesi halinde ise, talimatın verilmesini takip eden üçüncü işlem gününde yatırımcılara ödenir.

-Gerçek kişilerin fon katılma payı alım satım kazancı %0; tüzel kişilerin fon katılma payı alım satım kazancı %0 oranında stopaja tabidir.

-Katılma paylarının alım ve satımı kurucunun yanı sıra TEFAŞ'a üye olan fon dağıtım kuruluşları aracılığıyla da yapılır.

Risk ve Getiri Profili

Düşük Risk Potansiyel Düşük Getiri Yüksek Risk Potansiyel Yüksek Getiri

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

-Belirtilen risk değeri Fon'un gelecekteki risk profiline ilişkin güvenilir bir gösterge olmayabilir.

-Risk değeri zaman içinde değişebilir.

-En düşük risk değeri dahi, bu Fon'a yapılan yatırımın hiçbir risk taşımadığı anlamına gelmez.

-Fon'un belirtilen risk değerine sahip olma gerekçeleri: Fon, Borsa İstanbul'da işlem gören çeşitli finansal araçlarda algoritma destekli istatistiksel arbitraj fırsatlarını değerlendirerek düzenli ve dengeli kazanç sağlamayı amaçladığı için risk değeri 2 olarak belirlenmiştir.

- Fonun yatırım stratejisinde değişiklik olduğunda risk değerinin değişmesi beklenebilir. Fon, mutlak getiri amaçlı işlemlerine ek olarak piyasa yönlü stratejilere arbitraj da yapabilir ve bu işlemler yurt içi veya yurt dışı borsalarda, organize piyasalarda veya tezgahüstü piyasalarda gerçekleştirilebildiğinden risk değerini yükseltebilir; bu nedenle, piyasa koşulları ve stratejik değişikliklere bağlı olarak risk değeri değişebilir.

-Risk değeri önemli riskleri kapsamakla birlikte; kredi riski, likidite riski, karşı taraf riski, operasyonel risk, türev araç kullanımından kaynaklanan riskler ile piyasalardaki olağanüstü durumlardan kaynaklanabilecek riskleri içermez. Fonun maruz kalacağı temel risklere ilişkin açıklamalar aşağıda yer almaktadır.

Fon'un Maruz Kalacağı Temel Riskler

Fon'un maruz kalacağı temel riskler; piyasa riski, karşı taraf riski, likidite riski, kaldıraç yaratan işlem riski, operasyonel risk, yoğunlaşma riski, korelasyon riski, yasal risk, ihraççı riski, teminat riski, baz riski, opsiyon duyarlılık riskleri, yapılandırılmış yatırım araçları riski, açığa satış riski, işlemin sonuçlandırılmaması riski, veri güvenilirliği riski olup, bu risklere ilişkin detaylı açıklamalar Fon'un KAP (www.kap.org.tr) sayfasında yer almaktadır.

Ücret, Gider ve Komisyon Bilgileri

- Tabloda yer alan ücret, gider ve komisyonlar Fon'un getirisini doğrudan etkiler.

- Tabloda yer alan tutarlar Fon'un toplam gider sınırı kapsamında bir hesap dönemi boyunca Fon'dan tahsil edilmektedir. Ücret ve komisyonlar hakkında daha fazla bilgi için, www.kap.org.tr adresinden ulaşılacak fon izahnamesine ve ücretlerle ilgili diğer açıklamalara bakınız.

Fon'dan karşılanan giderler	%
Yönetim ücreti (yıllık)	4,00
Saklama ücreti	0,1
Diğer giderler (Tahmini)	0,3

Fon'un Geçmiş Performansı

- Fon'un geçmiş performansı, gelecek dönem performansı için bir gösterge olamaz.

- Fon performansının hesaplanmasında birim pay değeri esas alınmıştır.

- Fon paylarının satışına / /2024 tarihinde başlanmıştır.

Önemli Bilgiler

Fon, Nurol Portföy Yönetimi A.Ş.'nin kurucusu olduğu Nurol Portföy Yönetimi A.Ş. Serbest Şemsiye Fon'a bağlıdır.

Portföy saklayıcısı Nurol Yatırım Bankası A.Ş.'dir.

Fon hakkında daha fazla bilgiye, izahnameye, içtüzüğe, performans sunum raporuna, yıllık rapor ile finansal tablolara <http://www.kap.gov.tr/> ve www.nurolportfoy.com.tr adresinden ulaşılabilir.

Fon izahnamesi 31/07/2024 tarihinde Kamuyu Aydınlatma Platformu'nda yayımlanmıştır. Bu husus .../.../2024 tarihinde ticaret siciline tescil ettirilmiştir.

Fon katılma payı fiyatı TEFAS'ta ilan edilir.

Fon, T.C. vergi düzenlemelerine tâbidir. Fon'un tabi olduğu vergi düzenlemeleri ile ilgili Kararlara

www.gib.gov.tr ve Bakanlar Kurulu'nun 2006/10371 sayılı kararına

www.resmigazete.gov.tr/eskiler/2006/07/20060723-7.htm adresinden ulaşılabilir.

Nurol Portföy Yönetimi A.Ş.'nin, bu formla ilgili sorumluluğu, formdaki yanıltıcı, yanlış ve izahname ile tutarlı olmayan bilgiler ile sınırlıdır.

Şemsiye Fon'a bağlı her bir fonun tüm varlık ve yükümlülükleri birbirinden ayrıdır.

Fon ve Nurol Portföy Yönetimi A.Ş. Türkiye'de yetkilendirilmiş olup, Sermaye Piyasası Kurulu'nun gözetimine ve denetimine tâbidir.

Bu form, 31.07.2024 tarihi itibarıyla günceldir.