

OSMANLI PORTFÖY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

**1 OCAK - 31 ARALIK 2017 HESAP DÖNEMİNE AİT
PORTFÖY DAĞILIM RAPORU VE PAY FİYATININ
HESAPLANMASINA DAYANAK TEŞKİL EDEN
PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU VE TOPLAM DEĞER/
NET VARLIK DEĞERİ TABLOSUNU İÇEREN
FİYAT RAPORLARININ MEVZUATA UYGUN OLARAK
HAZIRLANMASINA İLİŞKİN RAPOR**

OSMANLI PORTFÖY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

PAY FİYATININ HESAPLANMASINA DAYANAK TEŞKİL EDEN PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU VE TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSUNU İÇEREN FİYAT RAPORLARININ MEVZUATA UYGUN OLARAK HAZIRLANMASINA İLİŞKİN RAPOR

Osmanlı Portföy Kısa Vadeli Borçlanma Araçları Fonu'nun ("Fon") pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 31 Aralık 2017 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 ilişkin Tebliğ (II-14.2) ("Tebliğ") hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca ("SPK") belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını SPK'nın konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2017 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Osmanlı Portföy Kısa Vadeli Borçlanma Araçları Fonu'nun pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 31 Aralık 2017 tarihi itibarıyla hazırlanan portföy değeri tablosu ve toplam değer/net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporları Tebliğ hükümlerine ve SPK tarafından belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanmıştır.

Bu görüş tamamen SPK ve Osmanlı Portföy Yönetimi A.Ş.'nin bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka bir maksatla kullanılması mümkün değildir.

Diğer Husus

Fon'un 31 Aralık 2016 tarihi itibarıyla hazırlanan Pay Fiyatının Hesaplanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporlarının incelemesi başka bir bağımsız denetim firması tarafından yapılmış ve 28 Şubat 2017 tarihli raporda söz konusu raporların Tebliğ hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlandığı belirtilmiştir.

PwC Bağımsız Denetim ve
Serbest Muhasebeci Mali Müşavirlik A.Ş.


Didem Demer Kaya, SMMM
Sorumlu Denetçi
İstanbul, 1 Mart 2018

OSMANLI PORTFÖY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

İÇİNDEKİLER	SAYFA
I- FONU TANITICI BİLGİLER.....	1
II- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER.....	2-3
III- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	4-7
IV- TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU.....	8
V- YIL İÇİNDE YAPILAN GİDERLER.....	9
VI- DİĞER AÇIKLAMALAR.....	10
VII- PORTFÖYDEN SATIŞLAR.....	11
VIII- İTFALAR.....	12
IX- PORTFÖYE ALIŞLAR.....	13
X- FİYAT RAPORLARINA İLİŞKİN PORTFÖY DEĞERLEME ESASLARI.....	14

OSMANLI PORTFÖY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

FONU TANITICI BİLGİLER

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

A. FONUN ADI:

Osmanlı Portföy Kısa Vadeli Borçlanma Araçları Fonu.

B. KURUCUNUN ÜNVANI:

Osmanlı Portföy Yönetimi A.Ş.

C. YÖNETİCİNİN ÜNVANI:

Osmanlı Portföy Yönetimi A.Ş.

D. FON TUTARI:

Fonun tutarı 30.000.000 TL'dir.

E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:

Fonun toplam değeri 16.289.764 TL'dir.

F. KATILMA PAYI SAYISI:

Fonun katılma payı sayısı 895.167.845 adettir.

G. FONUN KURULUŞ TARİHİ:

Fon 13 Nisan 2006 tarihinde kurulmuştur.

H. FONUN SÜRESİ:

Fon süresizdir.

OSMANLI PORTFÖY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

A. YIL SONU KATILMA PAYI FİYATI:

Fonun yıl sonu katılma payı fiyatı 0,018197 TL'dir.

B. ÖNCEKİ YIL KATILMA PAYI FİYATI:

Fonun önceki yıl katılma payı fiyatı 0,016416 TL'dir.

C. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:

Yıllık katılma payı fiyatı artış oranı %10,85'tir.

D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:

Yıllık katılma payı fiyatı artış oranı %10,85'tir.

E. YILLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:

Devlet Tahvili	3,39%
Özel Sektör Tahvili	34,87%
Finansman Bonosu	36,74%
Özel sektör Bonosu	5,85%
Vadeli Mevduat	3,68%
Borsa Para Piyasası	11,01%
Ters repo	2,99%
Hazine Bonosu	1,47%

OSMANLI PORTFÖY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

E. YILLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:

Yıllık ortalama tedavül oranı 30,75%’dir.

G. YILLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:

Yıllık ortalama portföy devir hızı 3,50%’dir.

H. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:

Portföyün ortalama vadesi 630,14 gündür.

I. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ:

Katılma payı ihraçlarından kaynaklanan nakit girişleri 501.443.742 TL'dir.

J. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:

Katılma payı iadelerinden kaynaklanan nakit çıkışları 503.703.575 TL'dir.

OSMANLI PORTFÖY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

İhraççı	Vade	ISIN Kodu	Nominal Faiz Oran	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi(3)	İç İskonto Oran	Borsa Sözleşme No(4)	Repo Teminat Tutarı(5)	Günlük Birim Değer	Toplam Değer/Net Varlık Değeri	Grup (%)	Toplam (%)
A. PAY														
B. BORÇLANMA ARAÇLARI														
B.1. ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI														
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ														
AKFEN HOLDİNG A.Ş.	19.03.2020	TRSAKFH32013	0,04	4	50.000,00	100,00	20.10.2017	0,00	0	0,00	102,21	51.105,31	0,00	0,00
AKFEN HOLDİNG A.Ş.	19.03.2020	TRSAKFH32013	0,04	4	100.000,00	100,00	20.10.2017	0,00	0	0,00	102,21	102.210,62	0,01	0,01
AK FİNANSAL KİRALAMA	03.08.2018	TRSAKF81816	0,07	1	200.000,00	100,00	10.01.2017	0,00	0	0,00	104,95	209.899,73	0,02	0,01
AYGAZ A.Ş.	26.01.2018	TRSAYGZ11810	0,06	2	100.000,00	103,98	28.11.2017	0,00	0	0,00	105,33	105.326,95	0,01	0,01
DOĞUŞ HOLDİNG AŞ	01.03.2019	TRSDOGH31910	0,04	4	10.000,00	100,00	24.11.2017	0,00	0	0,00	101,58	10.158,02	0,00	0,00
DOĞUŞ HOLDİNG AŞ	01.03.2019	TRSDOGH31910	0,04	4	100.000,00	100,00	27.11.2017	0,00	0	0,00	101,58	101.580,20	0,01	0,01
DOĞUŞ HOLDİNG AŞ	01.03.2019	TRSDOGH31910	0,04	4	200.000,00	100,54	13.12.2017	0,00	0	0,00	101,58	203.160,41	0,02	0,01
ENERJISA ENERJİ AŞ	23.02.2021	TRSENJR22110	0,02	2	100.000,00	108,38	27.11.2017	0,00	0	0,00	111,22	111.216,17	0,01	0,01
ENERJISA ENERJİ AŞ	23.02.2021	TRSENJR22110	0,02	2	100.000,00	108,52	01.12.2017	0,00	0	0,00	111,22	111.216,17	0,01	0,01
FİNANS FİNANSAL KİRALAMA A.Ş.	23.05.2018	TRSF5KR51813	0,04	4	100.000,00	100,00	09.10.2017	0,00	0	0,00	102,19	102.189,66	0,01	0,01
FİNANS FİNANSAL KİRALAMA A.Ş.	23.05.2018	TRSF5KR51813	0,04	4	200.000,00	100,00	11.10.2017	0,00	0	0,00	102,19	204.379,32	0,02	0,01
GARANTİ FİLO YÖNETİM	25.03.2019	TRSGFYH31914	0,04	5	180.000,00	100,00	25.09.2017	0,00	0	0,00	99,98	179.964,10	0,01	0,01
GARANTİ FİLO YÖNETİM	25.03.2019	TRSGFYH31914	0,04	5	180.000,00	100,00	27.09.2017	0,00	0	0,00	99,98	179.964,10	0,01	0,01
GARANTİ FİLO YÖNETİM	25.03.2019	TRSGFYH31914	0,04	5	100.000,00	100,00	05.12.2017	0,00	0	0,00	99,98	99.980,06	0,01	0,01
GARANTİ FİLO YÖNETİM	25.03.2019	TRSGFYH31914	0,04	5	100.000,00	100,00	05.12.2017	0,00	0	0,00	99,98	99.980,06	0,01	0,01
İŞ GAYRİMENKUL Y.O.	28.06.2019	TRISGY61912	0,04	4	80.000,00	100,00	01.07.2016	0,00	0	0,00	100,50	80.399,73	0,01	0,00
KOÇ FİNANSMAN A.Ş.	24.04.2018	TRSKCTF41817	0,05	2	100.000,00	100,00	22.03.2017	0,00	0	0,00	101,99	101.992,20	0,01	0,01
KOÇ FİNANSMAN A.Ş.	24.04.2018	TRSKCTF41817	0,05	2	200.000,00	100,00	30.03.2017	0,00	0	0,00	101,99	203.984,41	0,02	0,01
KOÇTAŞ Y.M.TİC A.Ş.	29.05.2018	TRSKCTY51817	0,06	2	100.000,00	100,00	09.02.2017	0,00	0	0,00	99,96	99.962,00	0,01	0,01
KOÇTAŞ Y.M.TİC A.Ş.	29.05.2018	TRSKCTY51817	0,06	2	200.000,00	99,87	15.05.2017	0,00	0	0,00	99,96	199.923,99	0,01	0,01
ORFİN FİNANSMAN A.Ş.	06.12.2019	TRSORFNA1916	0,04	4	90.000,00	100,00	15.05.2017	0,00	0	0,00	101,72	91.546,26	0,01	0,01
ORFİN FİNANSMAN A.Ş.	30.10.2020	TRSORFNE2019	0,04	4	300.000,00	100,00	27.10.2017	0,00	0	0,00	102,77	308.316,97	0,02	0,02
ORFİN FİNANSMAN A.Ş.	02.02.2018	TRSORFN21812	0,01	3	50.000,00	99,25	15.12.2017	0,00	0	0,00	99,68	49.838,56	0,00	0,00
ORFİN FİNANSMAN A.Ş.	30.05.2018	TRSORFN51819	0,04	5	150.000,00	100,97	21.12.2017	0,00	0	0,00	101,45	152.175,29	0,01	0,01
ORFİN FİNANSMAN A.Ş.	30.05.2018	TRSORFN51819	0,04	5	300.000,00	101,33	29.12.2017	0,00	0	0,00	101,45	304.350,58	0,02	0,02
ŞEKER FİNANSAL KİR.	30.04.2019	TRSSKFK41911	0,0398	4	100.000,00	101,97	15.12.2017	0,00	0,00	0,00	103,09	103.094,00	0,01	0,01

OSMANLI PORTFÖY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

İhraççı	Vade	ISIN Kodu	Nominal Faiz Oran	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi(3)	İç İskonto Oran	Borsa Sözleşme No(4)	Repo Teminat Tutarı(5)	Günlük Birim Değer	Toplam Değer/Net Varlık Değeri	Grup (%)	Toplam (%)
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ														
HALK BANK A.Ş.	22.10.2027	TRSTHALE2716	0,0138	12	200.000,00	100,00	20.10.2017	0,00	0	0,00	100,98	201.958,08	0,02	0,01
HALK BANK A.Ş.	22.10.2027	TRSTHALE2716	0,01	12	300.000,00	100,00	24.10.2017	0,00	0	0,00	100,98	302.937,12	0,02	0,02
T.IS BANKASI	27.07.2027	TRSTISB72712	0,04	4	200.000,00	100,00	08.08.2017	0,00	0	0,00	102,82	205.645,70	0,02	0,01
T.IS BANKASI	27.07.2027	TRSTISB72712	0,04	4	50.000,00	100,00	17.08.2017	0,00	0	0,00	102,82	51.411,42	0,00	0,00
T.IS BANKASI	27.07.2027	TRSTISB72712	0,04	4	120.000,00	100,00	29.08.2017	0,00	0	0,00	102,82	123.387,42	0,01	0,01
T.IS BANKASI	27.07.2027	TRSTISB72712	0,04	4	200.000,00	101,31	08.12.2017	0,00	0	0,00	102,82	205.645,70	0,02	0,01
TÜRK TRAKTÖR VE ZİRAAT MAKİNEL	03.04.2020	TRSTTRK42012	0,03	4	70.000,00	100,00	19.04.2017	0,00	0	0,00	103,33	72.328,59	0,01	0,00
T. VAKIFLAR BANKASI	06.09.2027	TRSVKFB92719	0,04	4	200.000,00	100,00	16.11.2017	0,00	0	0,00	100,60	201.209,51	0,02	0,01
T. VAKIFLAR BANKASI	06.09.2027	TRSVKFB92719	0,04	4	300.000,00	100,00	17.11.2017	0,00	0	0,00	100,60	301.814,26	0,02	0,02
T. VAKIFLAR BANKASI	06.09.2027	TRSVKFB92719	0,04	4	130.000,00	100,00	24.11.2017	0,00	0	0,00	100,60	130.786,18	0,01	0,01
T. VAKIFLAR BANKASI	06.09.2027	TRSVKFB92719	0,04	4	200.000,00	100,00	13.12.2017	0,00	0	0,00	100,60	201.209,51	0,02	0,01
YAPI KREDİ FİNANSAL KİRALAMA	24.04.2018	TRSYKFK41810	0,03	4	100.000,00	100,00	07.11.2016	0,00	0	0,00	102,35	102.345,46	0,01	0,01
YAPI KREDİ FİNANSAL KİRALAMA	05.06.2018	TRSYKFK61818	0,04	4	30.000,00	100,00	08.02.2017	0,00	0	0,00	101,09	30.325,88	0,00	0,00
YAPI KREDİ FİNANSAL KİRALAMA	05.06.2018	TRSYKFK61818	0,04	4	50.000,00	100,00	09.02.2017	0,00	0	0,00	101,09	50.543,13	0,00	0,00
YAPI KREDİ FİNANSAL KİRALAMA	05.06.2018	TRSYKFK61818	0,04	4	100.000,00	100,00	10.03.2017	0,00	0	0,00	101,09	101.086,26	0,01	0,01
YAPI KREDİ FİNANSAL KİRALAMA	03.08.2018	TRSYKFK81816	0,04	4	50.000,00	100,00	09.02.2017	0,00	0	0,00	102,20	51.098,52	0,00	0,00
YAPI KREDİ FİNANSAL KİRALAMA	03.08.2018	TRSYKFK81816	0,04	4	200.000,00	100,00	19.04.2017	0,00	0	0,00	102,20	204.394,10	0,02	0,01
ARA TOPLAM					5.990.000,00							6.106.041,71		0,37
ÖZEL SEKTÖR FİNANSMAN BONOSU														
AK FİNANSAL KİRALAMA	07.05.2018	TRFAKFK51816	0,00	0	200.000,00	94,34	06.12.2017	0,00	0	0,00	95,39	190.787,41	0,01	0,01
AK FİNANSAL KİRALAMA	08.06.2018	TRFAKFK61815	0,00	0	100.000,00	93,81	25.12.2017	0,00	0	0,00	94,06	94.062,73	0,01	0,01
ALTERNATİF FİNANSAL	06.04.2018	TRFALFK41815	0,00	0	200.000,00	95,19	29.11.2017	0,00	0	0,00	96,41	192.819,48	0,01	0,01
ÇELİK MOTOR TİCARET	13.02.2018	TRFCLKM21819	0,00	0	100.000,00	94,55	21.09.2017	0,00	0	0,00	98,35	98.354,16	0,01	0,01
ÇELİK MOTOR TİCARET	13.02.2018	TRFCLKM21819	0,00	0	200.000,00	94,77	27.09.2017	0,00	0	0,00	98,35	196.708,32	0,01	0,01
ÇELİK MOTOR TİCARET	13.02.2018	TRFCLKM21819	0,00	0	200.000,00	95,43	11.10.2017	0,00	0	0,00	98,35	196.708,32	0,01	0,01
FİBABANK A.Ş.	30.05.2018	TRFFIBA51835	0,00	0	300.000,00	93,37	29.11.2017	0,00	0	0,00	94,54	283.605,95	0,02	0,02
FİBABANK A.Ş.	17.08.2018	TRFFIBA81816	0,00	0	200.000,00	88,58	19.09.2017	0,00	0	0,00	92,01	184.015,35	0,01	0,01
FİBABANK A.Ş.	17.08.2018	TRFFIBA81816	0,00	0	120.000,00	91,44	15.12.2017	0,00	0	0,00	92,01	110.409,21	0,01	0,01
FİNANS FAKTORİNG A.Ş.	15.03.2018	TRFFINF31815	0,00	0	100.000,00	93,97	28.09.2017	0,00	0	0,00	97,33	97.329,05	0,01	0,01
FİNANS FAKTORİNG A.Ş.	13.06.2018	TRFFINF61812	0	0	300.000,00	93,29	20.12.2017	0,00	0,00	0,00	93,74	281.208,95	0,02	0,02
FİNANS BANK A.Ş.	05.01.2018	TRFFNBK11812	0	0	200.000,00	93,65	11.07.2017	0,00	0,00	0,00	99,85	199.705,74	0,01	0,01

OSMANLI PORTFÖY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

İhraççı	Vade	ISIN Kodu	Nominal Faiz Oran	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer	Birim Ağış Fiyatı	Satın Ağış Tarihi(3)	İç İskonto Oran	Borsa Sözleşme No(4)	Repo Teminat Tutarı(5)	Günlük Birim Değer	Toplam Değer/Net Varlık Değeri	Grup (%)	Toplam (%)
ÖZEL SEKTÖR FİNANSMAN BONOSU														
FINANS BANK A.Ş.	09.02.2018	TRFFNBK21837	0	0	200.000,00	96,16	27.10.2017	0,00	0	0,00	98,56	197.121,37	0,01	0,01
GARANTİ BANKASI A.Ş.	14.05.2018	TRFGRAN51813	0,00	0	200.000,00	94,73	25.12.2017	0,00	0	0,00	94,99	189.973,56	0,01	0,01
GARANTİ FAKTORİNG H.	11.05.2018	TRFGRFA51819	0,00	0	200.000,00	93,60	15.11.2017	0,00	0	0,00	95,26	190.516,75	0,01	0,01
GARANTİ FAKTORİNG H.	18.05.2018	TRFGRFA51827	0,00	0	200.000,00	93,45	20.11.2017	0,00	0	0,00	94,94	189.889,88	0,01	0,01
GARANTİ FAKTORİNG H.	05.06.2018	TRFGRFA61818	0,00	0	200.000,00	93,41	13.12.2017	0,00	0	0,00	94,10	188.202,76	0,01	0,01
GÜVEN VARLIK YÖNETİM A.Ş.	13.04.2018	TRFGVYA41813	0,00	0	100.000,00	93,64	24.10.2017	0,00	0	0,00	96,16	96.160,08	0,01	0,01
GÜVEN VARLIK YÖNETİM A.Ş.	13.04.2018	TRFGVYA41813	0,00	0	200.000,00	95,54	15.12.2017	0,00	0	0,00	96,16	192.320,16	0,01	0,01
GÜVEN VARLIK YÖNETİM A.Ş.	24.05.2018	TRFGVYA51812	0,00	0	250.000,00	94,05	21.12.2017	0,00	0	0,00	94,47	236.164,64	0,02	0,01
HALK FİNANSAL K.	05.01.2018	TRFHLEK11821	0,00	0	400.000,00	93,75	14.07.2017	0,00	0	0,00	99,85	399.404,47	0,03	0,02
İŞ FAKTORİNG A.Ş.	05.01.2018	TRFISFA11817	0,00	0	400.000,00	93,66	10.07.2017	0,00	0	0,00	99,85	399.415,06	0,03	0,02
İŞ FİNANSAL KİRALAMA	21.05.2018	TRFISFN51816	0,00	0	200.000,00	93,90	05.12.2017	0,00	0	0,00	94,86	189.713,50	0,01	0,01
İŞ FİNANSAL KİRALAMA	08.06.2018	TRFISFN61815	0,00	0	200.000,00	93,70	22.12.2017	0,00	0	0,00	94,07	188.132,93	0,01	0,01
İŞ YATIRIM MENKUL	15.05.2018	TRFISMD51821	0,00	0	100.000,00	93,63	20.11.2017	0,00	0	0,00	95,12	95.115,34	0,01	0,01
NUROL YATIRIM BANKA	07.02.2018	TRFNURL21822	0,00	0	250.000,00	97,37	28.11.2017	0,00	0	0,00	98,58	246.441,31	0,02	0,02
NUROL YATIRIM BANKA	08.03.2018	TRFNURL31821	0,00	0	200.000,00	95,61	09.11.2017	0,00	0	0,00	97,66	195.322,02	0,01	0,01
ŞEKER FİNANSAL KİR.	23.10.2018	TRFSKFKE1814	0,04	4	100.000,00	101,02	17.11.2017	0,00	0	0,00	102,91	102.913,37	0,01	0,01
T.EKONOMİ BANKASI AŞ	15.03.2018	TRFTEBK31828	0,00	0	200.000,00	96,13	30.11.2017	0,00	0	0,00	97,29	194.585,17	0,01	0,01
T.EKONOMİ BANKASI AŞ	17.05.2018	TRFTEBK51818	0,00	0	100.000,00	93,87	30.11.2017	0,00	0	0,00	95,00	95.003,82	0,01	0,01
VAKIF FAKTORİNG A.Ş.	06.06.2018	TRFVFAS61815	0,00	0	200.000,00	93,46	13.12.2017	0,00	0	0,00	94,15	188.294,09	0,01	0,01
VAKIF FİNANSAL KİRALAMA A.Ş.	22.02.2018	TRFVKFK21815	0,00	0	300.000,00	93,69	29.08.2017	0,00	0	0,00	98,10	294.306,85	0,02	0,02
AKA TOPLAM					6.420.000,00							6.194.711,80		0,38
B.2. KAMU SEKTÖRÜ BORÇLANMA ARAÇLARI														
DEVLET TAHVİLİ														
T.C. HAZİNE MÜSTEŞARLIĞI	08.03.2023	TRT080323T10	0,04	2	106,00	84,97	07.01.2014	0,00	0	0,00	84,16	89,21	0,00	0,00
T.C. HAZİNE MÜSTEŞARLIĞI	14.02.2018	TRT140218T10	0,03	2	100.000,00	96,10	14.11.2016	0,00	0	0,00	101,64	101.639,70	0,01	0,01
T.C. HAZİNE MÜSTEŞARLIĞI	14.02.2018	TRT140218T10	0,03	2	200.000,00	100,50	27.11.2017	0,00	0	0,00	101,64	203.279,41	0,02	0,01
T.C. HAZİNE MÜSTEŞARLIĞI	14.02.2018	TRT140218T10	0,03	2	100.000,00	100,50	27.11.2017	0,00	0	0,00	101,64	101.639,70	0,01	0,01
T.C. HAZİNE MÜSTEŞARLIĞI	14.02.2018	TRT140218T10	0,03	2	90.000,00	100,49	29.11.2017	0,00	0	0,00	101,64	91.475,73	0,01	0,01
T.C. HAZİNE MÜSTEŞARLIĞI	14.09.2022	TRT140922T17	0,04	2	70,00	108,16	22.05.2013	0,00	0	0,00	90,46	63,32	0,00	0,00
T.C. HAZİNE MÜSTEŞARLIĞI	20.02.2019	TRT200219T11	0,02	2	100.000,00	127,50	19.07.2017	0,00	0	0,00	144,02	144.019,24	0,01	0,01
T.C. HAZİNE MÜSTEŞARLIĞI	20.02.2019	TRT200219T11	0,0175	2	100.000,00	136,97	21.09.2017	0,00	0,00	0,00	144,02	144.019,24	0,01	0,01

OSMANLI PORTFÖY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

	İhraççı	Vade	ISIN Kodu	Nominal Faiz Oran	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi(3)	İç İskonto Oran	Borsa Sözleşme No(4)	Repo Teminat Tutarı(5)	Günlük Birim Değer	Toplam Değer/Net Varlık Değeri	Grup (%)	Toplam (%)
DEVLET TAHVİLİ															
	T.C. HAZİNE MÜSTEŞARLIĞI	20.06.2018	TRT200618T18	0,04	2	366,00	94,60	09.01.2014	0,00	0	0,00	98,00	358,70	0,00	0,00
	T.C. HAZİNE MÜSTEŞARLIĞI	23.02.2022	TRT230222T13	0,02	2	553,00	109,36	03.12.2012	0,00	0	0,00	162,89	900,76	0,00	0,00
	T.C. HAZİNE MÜSTEŞARLIĞI	24.07.2024	TRT240724T15	0,05	2	86,00	96,90	01.10.2014	0,00	0	0,00	92,98	79,96	0,00	0,00
	T.C. HAZİNE MÜSTEŞARLIĞI	26.10.2022	TRT261022T10	0,01	2	416,00	104,73	09.01.2013	0,00	0	0,00	150,73	627,02	0,00	0,00
	T.C. HAZİNE MÜSTEŞARLIĞI	27.09.2023	TRT270923T11	0,04	2	586,00	93,22	05.03.2014	0,00	0	0,00	89,68	525,50	0,00	0,00
ARA GRUP TOPLAMI						692.183,00							788.717,49		0,05
GRUP TOPLAMI						13.102.183,00							13.089.471,00		0,80
C. KIRA SERTİFİKALARI															
OZEL SEKTÖR KIRA SERTİFİKA															
	HALK VARLIK KİRALAMA A.Ş.	16.03.2018	TRDHVKA31816	0,03	1	300.000,00	100,00	19.12.2017	0,00	0	0,00	100,47	301.397,02	0,02	0,02
GRUP TOPLAMI						300.000,00							301.397,02		0,02
D. DİĞER VARLIKLAR															
TERS REPO															
	BİST	04.01.2018	TRSDRND31918	0,14	0	702.071,23	100,77	27.12.2017	0,14	0	694.630,00	100,96	701.293,80	0,53	0,04
	BİST	04.01.2018	TRSODAS21911	0,14	0	621.834,52	101,50	27.12.2017	0,14	0	610.815,00	101,69	621.145,94	0,47	0,04
ARA GRUP TOPLAMI						1.323.905,75							1.322.439,74		0,08
TAKASBANK BORSA PARA PIYASASI															
	TAKASBANK	02.01.2018	TBPP	0,13	0	100.145,00	100.000,00	29.12.2017	0,00	0	0,00	0,00	100.106,61	0,11	0,01
	TAKASBANK	02.01.2018	TBPP	0,12	0	130.167,00	130.000,00	29.12.2017	0,00	0	0,00	0,00	130.117,23	0,14	0,01
	TAKASBANK	02.01.2018	TBPP	0,12	0	100.130,00	100.000,00	29.12.2017	0,00	0	0,00	0,00	100.091,82	0,11	0,01
	TAKASBANK	02.01.2018	TBPP	0,12	0	200.263,00	200.000,00	29.12.2017	0,00	0	0,00	0,00	200.186,93	0,21	0,01
	TAKASBANK	04.01.2018	TBPP	0,14	0	101.673,00	100.000,00	22.11.2017	0,00	0	0,00	0,00	101.564,00	0,11	0,01
	TAKASBANK	10.01.2018	TBPP	0,14	0	101.248,00	100.000,00	08.12.2017	0,00	0	0,00	0,00	100.905,94	0,11	0,01
	TAKASBANK	15.01.2018	TBPP	0,14	0	101.304,00	100.000,00	12.12.2017	0,00	0	0,00	0,00	100.750,98	0,11	0,01
	TAKASBANK	06.02.2018	TBPP	0,14	0	102.351,00	100.000,00	08.12.2017	0,00	0	0,00	0,00	100.929,10	0,11	0,01
ARA GRUP TOPLAMI						937.281,00							934.652,61		0,06
MEVDUAT															
	T GARANTİ BANKASI A.Ş.	02.01.2018	VADELİ/TL	0,14		314.828,00	310.687,00	28.11.2017	0,00	0	0,00	0,00	314.709,00	0,47	0,02
	DENİZBANK	12.01.2018	VADELİ/TL	0,15		357.802,00	353.758,90	15.12.2017	0,00	0	0,00	0,00	356.208,41	0,53	0,02
ARA GRUP TOPLAMI						672.630,00							670.917,41		0,04
GRUP TOPLAMI						2.933.816,75							2.928.009,76		0,18
FON PORTFOY DEĞERİ						16.335.999,75							16.318.877,78		1,00

OSMANLI PORTFÖY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

	31 Aralık 2017		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %
Fon/ortaklık portföy değeri	16.318.878	-	100,18%
Hazır değerler	2.178	100%	0,01%
Kasa	-	-	-
Bankalar	-	-	-
Diğer hazır değerler	2.178	100%	0,01%
Alacaklar	-	-	-
Takastan alacaklar	-	-	-
Diğer alacaklar	-	-	-
Diğer varlıklar	-	-	-
Borçlar	31.292	100%	0,19%
Takasa borçlar	-	-	-
Yönetim ücreti	20.074	64%	0,12%
Ödenecek vergi	-	-	-
İhtiyatlar	-	-	-
Krediler	-	-	-
Diğer borçlar	11.218	36%	0,07%
Toplam değer/net varlık değeri	16.289.764		100%
Toplam katılma payı/Pay sayısı	3.000.000.000		
Yatırım fonları için kurucu tarafından iktisap edilen katılma payı	0,018197		

OSMANLI PORTFÖY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

YIL İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

	1 Ocak - 31 Aralık 2017
SPK kayda alma ücretleri	3.059
Borsa para BSMV karşılığı	4.271
Aracılık komisyon giderleri	21.416
Saklama giderleri	37.510
Fon yönetim ücretleri	218.752
Denetim ücretleri	7.644
Tahvil ve borsa payı	2.077
Diğer giderler	44.006
	338.735

OSMANLI PORTFÖY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

DİĞER AÇIKLAMALAR

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

A. Geçen Yıl İçinde Rüçhan Hakkı Kullanımı, Bedelsiz Pay Alımı, Temettü ve Anapara Tahsilatına İlişkin Açıklamalar

Bulunmamaktadır.

B. Geçen Yıl İçinde Yatırım Fonlarına İlişkin Mevzuatta Meydana Gelen Değişme ve Hukuki İhtilaflarla İlgili Açıklamalar

Bulunmamaktadır.

OSMANLI PORTFÖY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

PORTFÖYDEN SATIŞLAR

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

Sermaye Piyasası Kurulu’nun yayınlamış olduğu Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Esaslarına İlişkin Tebliği (II-14.2)’nin "Portföy dağılım raporları" konulu 10. maddesinin (4) nolu bendi uyarınca, satış detaylarına yer verilmemiştir.

OSMANLI PORTFÖY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

İTFALAR

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

Sermaye Piyasası Kurulu’nun yayınlamış olduğu Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Esaslarına İlişkin Tebliği (II-14.2)' nin "Portföy dağılım raporları" konulu 10. maddesinin (4) nolu bendi uyarınca, itfa detaylarına yer verilmemiştir.

OSMANLI PORTFÖY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

PORTFÖYE ALIŞLAR

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası (“TL”) olarak ifade edilmiştir.)

Sermaye Piyasası Kurulu’nun yayınlamış olduğu Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Esaslarına İlişkin Tebliği (II-14.2)’nin "Portföy dağılım raporları" konulu 10. maddesinin (4) nolu bendi uyarınca, alış detaylarına yer verilmemiştir.

OSMANLI PORTFÖY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

FİYAT RAPORLARINA İLİŞKİN PORTFÖY DEĞERLEME ESASLARI

(Tutarlar aksi belirtilmedikçe Türk Lirası ("TL") olarak ifade edilmiştir.)

- 1) Portföydeki varlıkların değeri aşağıdaki esaslara göre tespit edilir:
 - a) Portföye alınan varlıklar alım fiyatlarıyla kayda geçirilir. Yabancı para cinsinden varlıkların alım fiyatı satın alma günündeki yabancı para cinsinden değerinin T.C. Merkez Bankası ("TCMB") döviz satış kuru ile çarpılması suretiyle bulunur.
 - b) Alış tarihinden başlamak üzere portföydeki varlıklardan;
 - 1) Borsada işlem görenler değerlendirme gününde borsada oluşan en son seans ağırlıklı ortalama fiyat veya oranlarla değerlendirilir. Şu kadar ki, kapanış seansı uygulaması bulunan piyasalarda işlem gören varlıkların değerlemesinde kapanış seansında oluşan fiyatlar, kapanış seansında fiyatın oluşmaması durumunda ise borsada oluşan en son seans ağırlıklı ortalama fiyatlar kullanılır.
 - 2) Borsada işlem görmekle birlikte değerlendirme gününde borsada alım satımına konu olmayan paylar son işlem tarihindeki borsa fiyatıyla; borçlanma araçları, ters repo ve repolar son işlem günündeki iç verim oranı ile değerlendirilir.
 - 3) Fon katılma payları, değerlendirme günü itibarıyla en son açıklanan fiyatları esas alınarak değerlendirilir.
 - 4) Vadeli mevduat, bileşik faiz oranı kullanılarak tahakkuk eden faizin anaparaya eklenmesi suretiyle değerlendirilir.
 - 5) Yabancı para cinsinden olanlar, TCMB tarafından ilgili yabancı para için belirlenen döviz alış kuru ile değerlendirilir.
 - 6) Türev araçlar nedeniyle teminat olarak verilen varlıklar da portföy değeri tablosunda gösterilir. Bu varlıklar teminatın türü dikkate alınarak bu maddedeki esaslar çerçevesinde değerlendirilir.
 - 7) Borsa dışı repo-ters repo sözleşmeleri, piyasa fiyatını en doğru yansıtabilecek şekilde güvenilir ve doğrulanabilir bir yöntemle değerlendirilir.
 - 8) (1) ile (7) nolu alt bentlerde belirtilenler dışında kalanlar, Kamu Gözetimi Muhasebe ve Denetim Standartları Kurumu ("KGK") tarafından yayımlanan Türkiye Muhasebe Standartları ("TMS") / Türkiye Finansal Raporlama Standartları ("TFRS") dikkate alınarak değerlendirilir. Değerleme esasları, yazılı karara bağlanır.
 - 9) (7) ve (8) nolu alt bentlerde yer alan yöntemlere ilişkin kararlar kurucunun yönetim kurulu tarafından alınır.
 - c) Endeks fonların portföylerinde yer alan varlıklardan; baz alınan endeks kapsamında bulunan varlıklar endeksin hesaplanmasında kullanılan esaslar, diğer varlıklar ise (b) bendinde belirtilen esaslar çerçevesinde değerlendirilir.
- 2) Fonun diğer varlık ve yükümlülükleri, KGK tarafından yayımlanan TMS/TFRS dikkate alınarak değerlendirilir. Şu kadar ki, fonun yabancı para cinsinden yükümlülükleri TCMB tarafından ilgili yabancı para için belirlenen döviz satış kuru ile çarpılması suretiyle değerlendirilir.

.....