

ATA PORTFÖY
KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

1 OCAK-31 ARALIK 2018 DÖNEMİNE AİT
FİYAT RAPORU

ATA PORTFÖY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

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 Kısa Vadeli Borçlanma Araçları Fonu'nun ("Fon") pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 31 Aralık 2018 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 (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 2018 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Ata Portföy Kısa Vadeli Borçlanma Araçları Fonu'nun pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 31 Aralık 2018 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, Kurucu Yönetim Kurulu ve Ata Portföy Yönetimi A.Ş.'nin ("Kurucu") bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka maksatla kullanılması mümkün değildir.

DRT BAĞIMSIZ DENETİM VE SERBEST MUHASEBECİ MALİ MÜŞAVİRLİK A.Ş.
Member of DELOITTE TOUCHE TOHMATSU LIMITED

H. Ali Bekçe, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 26 Nisan 2019

31/12/2018 Tarihli Ata Portföy Kısa Vadeli Borçlanma Araçları Fonu
Fon Toplam Değer Raporu

	TUTARI(TL)	GRUP (%)	TOPLAM (%)		TUTARI(TL)	GRUP (%)	TOPLAM (%)
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	8.456.380		100,21%	FON TOPLAM DEĞERİ	8.438.907		
(MİZANDAN PORTFÖY DEĞERİ)	8.456.380		100,21%	Toplam Pay Sayısı	170.000.000.000		
B. HAZİR DEĞERLER	-		0,00%	Dolaşımdaki Pay Sayısı	457.703.337		
a) Kasa	-		0,00%	Kurucunun Elindeki Pay Sayısı	-		
b) Bankalar	-		0,00%	Merkezdeki Pay Sayısı	169.542.296.663		
i) TL Hesaplar	-		0,00%	Fiyat	0,018438		
ii) Yabancı Para TL Karşılığı	-		0,00%	(VOB Açık Pozisyon)	-		0,00%
iii) VOB Nakit Teminatları (Alacakları)	-		0,00%	Pay Sahibi Sayısı	-		
c) Diğer Hazır Değerler	-		0,00%	Günlük Yönetim Ücreti	8.367		
C. ALACAKLAR	-		0,00%	Dünkü Fiyat			
a) Takastan Alacaklar T1	-		0,00%				
b) Takastan Alacaklar T2	-		0,00%				
c) Takastan BPP Alacakları	-		0,00%				
d) Diğer Alacaklar	-		0,00%				
D. DİĞER VARLIKLAR	-		0,00%				
E. BORÇLAR	17.473		-0,21%				
a) Takasa Borçlar T1	-	0,00%	0,00%				
b) Takasa Borçlar T2	-	0,00%	0,00%				
c) Yönetim Ücreti	8.656	49,54%	-0,10%				
d) Ödenecek Vergi	-	0,00%	0,00%				
e) İhtiyatlar	-	0,00%	0,00%				
f) Krediler	-	0,00%	0,00%				
g) Diğer Borçlar	8.816	50,46%	-0,10%				
i) Denetim Ücreti	3.197	18,30%	-0,04%				
ii) İlan Giderleri	-	0,00%	0,00%				
iii) Noter Masrafı	-	0,00%	0,00%				
iv) İhraç İzin Gideri	441	2,53%	-0,01%				
v) Takas Saklama Komisyonu	-	0,00%	0,00%				
vi) Diğer	5.178	29,63%	-0,06%				
F. M.D.Düşüş Karşılığı	-		0,00%				
FON TOPLAM DEĞERİ	8.438.907						

31/12/2018 Tarihli Ata Portföy Kısa Vadeli Borçlanma Araçları Fonu
Fon Portföy Raporu

Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	Menkul Tanımı	Nominal Faiz Oran	Ödeme Sayısı	Nominal Deger/ Kontrat Sayısı	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç Iskonto Oranı	Borsa Sözleşme No	Repo Teminat Tutarı	Günlük Birim Deger	Günlük Kur Deger	Toplam Deger	Grup (%)	Toplam (%)	F.T.D. (%)	Depo VKG	Stok Depo
A.HİSSE SENEDİ																			
8.BORÇLANMA SENETLERİ																			
DEVLET TAHVİLİ	T.C.	27/03/2019	TRT270319T13	5,20%	2	600.000	99,799	27/12/2018	23,96%			100,25577		601.535	27,83%	7,11%	7,13%	SRB	86
	T.C.	15/05/2019	TRT150519T15	5,55%	2	1.200.000	99,816	27/12/2018	22,60%			97,94167		1.175.300	54,37%	13,90%	13,93%	SRB	135
	T.C.	13/11/2019	TRT131119T19	6,50%	2	400.000	94,521	23/11/2018	12,44%			96,2167		384.867	17,80%	4,55%	4,56%	SRB	317
ARA GRUP TOPLAMI						2.200.000								2.161.701		25,56%	25,62%		
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ	AK Finansal Kirala	05/03/2019	TRFAKFK31925	0,00%	0	650.000	95,49707	27/12/2018	25,62%			96,1399	1	624.909	14,58%	7,39%	7,41%	SRB	64
	Alterbatifbank	08/03/2019	TRFALNF31919	0,00%	0	400.000	94,41	07/12/2018	25,95%			95,91382	1	383.655	8,95%	4,54%	4,55%	SRB	67
	Finansbank	01/03/2019	TRFFNBK31927	0,00%	0	400.000	94,745	07/12/2018	24,28%			96,54801	1	386.192	9,01%	4,57%	4,58%	SRB	60
	Garanti Leasing	25/01/2019	TRGGRFK11911	0,00%	0	400.000	96,19946	30/11/2018	24,75%			98,55654	1	394.276	9,20%	4,66%	4,67%	SRB	25
	Ziraat Bankası	23/02/2019	TRFTCZB21920	0,00%	0	400.000	95,324	07/12/2018	25,45%			96,821	1	387.284	9,03%	4,58%	4,59%	SRB	53
	Türk Ekonomi Bankası	24/01/2019	TRFTEBK11911	0,00%	0	500.000	95,487	16/11/2018	25,63%			96,57164	1	492.858	11,50%	5,83%	5,84%	SRB	24
	VakıfBank	01/03/2019	TRFVFB31920	0,00%	0	400.000	94,911	07/12/2018	25,46%			96,40062	1	385.602	8,99%	4,56%	4,57%	SRB	60
	Vakıf Leasing	15/01/2019	TRFVLFK11915	0,00%	0	350.000	93,327	17/10/2018	25,82%			99,123	1	346.931	8,09%	4,10%	4,11%	SRB	15
	Yapı Kredi Yatırım	13/02/2019	TRFYKM21915	0,00%	0	300.000	95,98317	10/12/2018	24,09%			97,48965	1	292.469	6,82%	3,46%	3,47%	SRB	44
	Ata Gayrimenkul Y.Ö.	18/10/2019	TRSATAYE1918	7,18%	4	560.000	100,98825	23/11/2018	0,01%			105,85315	1	592.778	13,83%	7,01%	7,02%	SRB	291
ARA GRUP TOPLAMI						4.360.000								4.286.905		50,69%	50,80%		
FINANSMAN BONUSU	Koçtaş	04/04/2019	TRFKTY41914	0,00%	0	400.000	86,813	10/10/2018	30,01%			93,53139		374.176	100,00%	4,42%	4,43%	SRB	94
ARA GRUP TOPLAMI						400.000								374.176		4,42%	4,43%		
C. KATILMA BELGESİ						6.960.000								6.822.732		80,68%	80,65%		
D. OPSİYON İŞLEMLERİ																			
E.YABANCI HİSSE																			
F.FİRENS REPO																			
G.KATILIM HESABI																			
H.VADELİ MEVDUAT																			
İ.KİYMETLİ MADEN																			
J.YABANCI TAHVİL																			
K.BORSA PARA FİYASASI																			
BPP		15/01/2019		24,30%		511.651	100.000,00	11/12/2018	26,55%			101.410,06		507.050	31,49%	6,00%	6,01%		15
		25/01/2019		23,75%		612.103	100.000,00	25/12/2018	26,54%			100.450,47		602.703	37,43%	7,13%	7,14%		25
		02/01/2019		0,44%		500.656	100.000,00	31/12/2018	27,04%			100.065,59		500.378	31,07%	5,92%	5,93%		2
GRUP TOPLAMI						1.624.410								1.610.081		19,04%	19,06%		
L.VARANT İŞLEMLERİ																			
M.TEMİNAT İŞLEMLERİ																			
VOB NARİT GRUP TOPLAMI						23.567	1	31/12/2018				1		23.567	100,00%	0,28%	0,28%		
N.SWAP İŞLEMLERİ						23.567								23.567		0,28%	0,28%		
O.EUROBOND REPO																			
FON PORTFÖY DEĞERİ						8.607.977						0		8.456.380					87