

OYAK PORTFÖY BİRİNCİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

02/05/2019 - 31/05/2019 TARİHLERİ ARASI FON RAPORU

1- FONU TANITICI BİLGİLER	
A. FONUN ADI:	OYAK PORTFÖY BİRİNCİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	OYAK PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş
C. YÖNETİCİ ÜNVANI:	OYAK PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş
D. FON TUTARI:	5,000,000,000.00
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	94,505,673.75
F. DOLAŞIMDAKİ PAY:	4,286,108,259.00
G. FONUN KURULUŞ TARİHİ:	23/07/2009
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER	
A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI:	0.022049
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	0.021573
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	2.21%
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	10.84%
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	24.54%
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
Hisse Senedi	
Varant	
Devlet Tahvili	4.17%
Özel Sektör Tahvili	64.66%
Finansman Bonosu	13.98%
Banka Bonosu	
Hazine Bonosu	
Devlet Tahvili Repo	16.94%
Kuponlar Repo	
Hazine Bonosu Repo	
Varlığa Dayalı Menkuller	
Kira Sertifikaları	
Katılım Hesabı	
Katılma Belgesi	
GES	
GOS	
Borsa Para Piyasası	0.26%
Kıymetli Madenler	
VOB İşlemleri	
VOB Nakit Teminat İşlemleri	
Yabancı Sabit Getiriliiler	
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)	
Opsiyon	
Swap	
Yabancı Hisse Senetleri	
Vadeli Mevduat TL	
Vadeli Mevduat Döviz	
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	73.94%
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	47.18%
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	345.238
J. AYLIK KORELASYON :	
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON :	
L. AYLIK TAKİP HATASI :	
M. AYLIK TAKİP HATASI(Yıllıklandırılmış) :	
N. AYLIK TAKİP FARKI :	
O. GEÇEN AYKİ TAKİP HATASI :	
P. GEÇEN AYKİ TAKİP HATASI(Yıllıklandırılmış) :	
R. GEÇEN AYKİ TAKİP FARKI :	
S. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ:	39,715,944.90
T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	30,328,886.31

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) VARANTLAR:			
C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:			
TRT120619T17	5,500,000.00	5,468,950.85	5.78%
TOPLAM :	5,500,000.00	5,468,950.85	5.78%
D) BANKA BONOLARI:			

E) FINANSMAN BONOLARI:			
TRFDFKT81917	1,600,000.00	1,508,210.88	1.59%
TRFDRFN91914	500,000.00	465,901.15	0.49%
TRFGLMD71919	2,500,000.00	2,600,804.25	2.75%
TRFHYYTK1913	500,000.00	504,052.35	0.53%
TRFISFN71947	1,000,000.00	972,710.20	1.03%
TRFKORT71910	1,560,000.00	1,527,769.78	1.61%
TRFKORT81927	500,000.00	470,463.40	0.50%
TRFKORT81935	1,800,000.00	1,700,027.82	1.80%
TRFKORT81943	200,000.00	187,548.06	0.20%
TRFMLPC91910	1,000,000.00	937,943.40	0.99%
TRFOYMD71916	500,000.00	488,471.70	0.52%
TRSORFN12019	500,000.00	513,496.15	0.54%
TOPLAM :	12,160,000.00	11,877,399.14	12.55%
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:			
TRSDNA92011	780,000.00	817,688.51	0.86%
TRSAKFH12015	5,000,000.00	5,170,737.50	5.47%
TRSAKFH32013	1,000,000.00	1,033,091.00	1.09%
TR SARCL22117	600,000.00	609,450.12	0.64%
TR SATAYE1918	750,000.00	773,109.45	0.82%
TRSBOLU12115	2,900,000.00	3,010,603.68	3.18%
TRSCMSA32112	700,000.00	735,464.59	0.78%
TRSEVA52119	5,040,000.00	5,133,762.14	5.43%
TRSERGL52117	5,500,000.00	5,511,811.80	5.83%
TRSGLMD12015	300,000.00	312,045.54	0.33%
TR SHEKT32123	900,000.00	951,567.93	1.01%
TR SHEKTA2014	4,170,000.00	4,390,725.61	4.64%
TRSHYTV22012	1,160,000.00	1,189,639.28	1.26%
TRSHYTV62117	1,010,000.00	1,056,503.13	1.12%
TRSHYTV71910	460,000.00	479,046.39	0.51%
TRSHYTV92015	300,000.00	318,815.01	0.34%
TRISGY12113	1,100,000.00	1,129,676.35	1.19%
TRISGYK1917	1,490,000.00	1,498,807.84	1.58%
TRSKRSNE1911	1,080,000.00	1,114,362.58	1.18%
TRSKRSNE2018	1,560,000.00	1,607,309.65	1.70%
TRSMGTI22115	3,300,000.00	3,322,792.44	3.51%
TRSMGTI72110	1,170,000.00	1,217,136.73	1.29%
TRSMGTIE2015	300,000.00	309,729.45	0.33%
TRSMPLC61916	1,960,000.00	2,040,072.27	2.16%
TRSOPAS22129	600,000.00	604,526.70	0.64%
TRSORFN72013	2,500,000.00	2,532,342.25	2.68%
TR SOTKO32110	2,250,000.00	2,368,073.02	2.50%
TR SPLDG52014	3,600,000.00	3,652,849.44	3.86%
TRSYDAT32212	4,800,000.00	5,029,151.04	5.32%
TRSZORN71914	2,550,000.00	2,627,482.52	2.78%
TRSZORNE1918	2,070,000.00	2,127,013.39	2.25%
TOPLAM :	60,900,000.00	62,675,387.34	66.25%
G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:			
H) GELİRE ENDEKSLİ SENETLER:			
I) KİRA SERTİFİKALARI:			
J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:			
K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:			
L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:			
M) KATILIM HESAPLARI:			
N) KATILMA BELGELERİ:			
O) VOB İŞLEMLERİ:			
P) OPSİYON İŞLEMLERİ:			
R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:			
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:			
T) DİĞER:			
RRP TRT240724T15	14,530,092.47	14,530,092.47	15.36%
BPP	53,106.29	53,106.29	0.06%
TOPLAM :	14,583,198.76	14,583,198.76	15.41%
FON PORTFÖY DEĞERİ	93,143,198.76	94,604,936.08	

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:		
	Tutarı	%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	94,604,936.08	100.11%
B. HAZİR DEĞERLER (+) :	14,835.51	0.02%
C. ALACAKLAR (+) :	0.00	0.00%
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0	0.00%
E. BORÇLAR (-) :	114,097.84	0.12%
FON TOPLAM DEĞERİ:	94,505,673.75	

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	
Açıklama	Tutarı
37001Fon Yönetim Ücreti	106,322.69
37002Denetim Ücreti	416.00
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	773.44
3700320/N RRP Tahvil Borsa Payı	2,509.50
370033Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	2,000.25
37005Vergi, Resim ve Harçlar	122.90
37006Saklama Giderleri	6,108.95
37008Banka Masrafları	111.73
370142BIST Endeks K.Ölçütü Kullanım Bedeli	1,062.00
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	127.10
37030E-Defter ve E-Fatura Bakım Bedeli Gideri	301.22
37042BPP BSMV Gideri	50.91
37098Küsürat farkları	0.10
TOPLAM	119,906.79

6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI.	
TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR	
Açıklama	Nominal Değeri

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR:				
Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Satış Tarihi	Nominal Değer	Satış Değeri
Borsa Para Piyasası		02/05/2019	67,000.00	67,000.00
Borsa Para Piyasası		03/05/2019	423,000.00	423,000.00
Borsa Para Piyasası		06/05/2019	137,000.00	137,000.00
Borsa Para Piyasası		07/05/2019	345,000.00	345,000.00
Borsa Para Piyasası		08/05/2019	39,000.00	39,000.00
Borsa Para Piyasası		09/05/2019	172,000.00	172,000.00
Borsa Para Piyasası		10/05/2019	165,000.00	165,000.00
Borsa Para Piyasası		13/05/2019	71,000.00	71,000.00
Borsa Para Piyasası		14/05/2019	490,000.00	490,000.00
Borsa Para Piyasası		15/05/2019	209,000.00	209,000.00
Borsa Para Piyasası		16/05/2019	312,000.00	312,000.00
Borsa Para Piyasası		17/05/2019	192,000.00	192,000.00
Borsa Para Piyasası		20/05/2019	110,000.00	110,000.00
Borsa Para Piyasası		21/05/2019	216,000.00	216,000.00
Borsa Para Piyasası		22/05/2019	205,000.00	205,000.00
Borsa Para Piyasası		23/05/2019	361,000.00	361,000.00
Borsa Para Piyasası		24/05/2019	428,000.00	428,000.00
Borsa Para Piyasası		27/05/2019	18,000.00	18,000.00
Borsa Para Piyasası		28/05/2019	85,000.00	85,000.00
Borsa Para Piyasası		29/05/2019	85,000.00	85,000.00
Borsa Para Piyasası		30/05/2019	310,000.00	310,000.00
Borsa Para Piyasası		31/05/2019	53,000.00	53,000.00
TOPLAM :			4,493,000.00	4,493,000.00
Devlet Tahvili	TRT150120T16	23/05/2019	500,000.00	480,567.31
Devlet Tahvili	TRT150120T16	23/05/2019	500,000.00	480,567.31
Devlet Tahvili	TRT150120T16	24/05/2019	1,000,000.00	962,423.08
Devlet Tahvili	TRT100719T18	31/05/2019	1,000,000.00	1,016,659.34
TOPLAM :			3,000,000.00	2,940,217.04
Özel Sektör Tahvili	TRSHEKT32123	02/05/2019	300,000.00	310,466.21
Özel Sektör Tahvili	TRSBOLU12115	03/05/2019	150,000.00	152,044.60
Özel Sektör Tahvili	TRSHEKT32123	15/05/2019	300,000.00	313,187.42
Özel Sektör Tahvili	TRSBOLU12115	16/05/2019	200,000.00	204,695.02
Özel Sektör Tahvili	TRSBOLU12115	17/05/2019	250,000.00	256,058.09
Özel Sektör Tahvili	TRSHEKT32123	20/05/2019	200,000.00	209,491.36
Özel Sektör Tahvili	TRSHEKT32123	22/05/2019	400,000.00	419,536.92
Özel Sektör Tahvili	TRSHEKT32123	24/05/2019	200,000.00	210,047.56

8- İTFALAR				
Menkul Kıymet Türü	İtfai Tarihi	Nominal Değeri		
TRFTPC51911	10/05/2019	2,470,000.00		
TRFSUZK51914	14/05/2019	500,000.00		
TRT150519T15	15/05/2019	5,000,000.00		
TRSGZDF51918	24/05/2019	830,000.00		

9- PORTFÖYE ALIŞLAR:				
Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Alış Tarihi-G.D.Tarih	Nominal Değeri	Alış Değeri
Devlet Tahvili	TRT150519T15	08/05/2019	1,000,000.00	1,050,515.38
Devlet Tahvili	TRT150120T16	10/05/2019	500,000.00	472,875.00
Devlet Tahvili	TRT150120T16	14/05/2019	1,500,000.00	1,424,307.69
Devlet Tahvili	TRT100719T18	24/05/2019	1,000,000.00	1,011,774.73
Devlet Tahvili	TRT120619T17	30/05/2019	5,000,000.00	4,959,373.90
Devlet Tahvili	TRT120619T17	30/05/2019	500,000.00	495,937.39
TOPLAM :			9,500,000.00	9,414,784.09
Devlet Tahvili Repo	TRT200422T14	02/05/19-03/05/19	16,043,495.00	15,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT110320T18	03/05/19-06/05/19	5,605,895.00	5,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT050624T19	06/05/19-07/05/19	6,843,790.00	7,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT150120T16	07/05/19-08/05/19	542,385.00	500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT150120T16	07/05/19-08/05/19	7,050,905.00	6,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT060825T15	08/05/19-09/05/19	1,039,985.00	1,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT131119T19	08/05/19-09/05/19	10,715,880.00	10,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT100124T17	09/05/19-10/05/19	10,016,590.00	10,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT120619T17	09/05/19-10/05/19	4,212,225.00	4,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT020823T11	10/05/19-13/05/19	1,443,070.00	2,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT020823T11	10/05/19-13/05/19	6,926,710.00	12,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT081123T10	13/05/19-14/05/19	1,770,270.00	3,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT111120T18	13/05/19-14/05/19	10,919,775.00	11,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT060121T16	14/05/19-15/05/19	6,690,890.00	14,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT020322T17	15/05/19-16/05/19	5,360,145.00	4,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT131119T19	15/05/19-16/05/19	12,424,330.00	11,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT120619T17	16/05/19-17/05/19	14,679,925.00	14,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT120619T17	17/05/19-20/05/19	5,774,375.00	5,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT240724T15	17/05/19-20/05/19	12,646,330.00	8,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT060121T16	20/05/19-21/05/19	5,957,620.00	12,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT100124T17	20/05/19-21/05/19	2,020,330.00	2,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT111120T18	21/05/19-22/05/19	8,518,485.00	8,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT131119T19	21/05/19-22/05/19	7,006,640.00	6,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT140623T19	22/05/19-23/05/19	6,700,360.00	6,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200422T14	22/05/19-23/05/19	10,055,145.00	9,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT110226T13	23/05/19-24/05/19	7,396,255.00	5,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT110827T16	23/05/19-24/05/19	15,873,785.00	10,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT081123T10	24/05/19-27/05/19	2,983,385.00	5,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT140922T17	24/05/19-27/05/19	14,805,715.00	10,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT150120T16	27/05/19-28/05/19	534,080.00	500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT261022T10	27/05/19-28/05/19	8,812,525.00	15,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT220921T18	28/05/19-29/05/19	21,647,255.00	16,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT060825T15	29/05/19-30/05/19	4,268,350.00	4,000,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT131119T19	29/05/19-30/05/19	13,408,075.00	12,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT081123T10	30/05/19-31/05/19	891,445.00	1,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT200422T14	30/05/19-31/05/19	17,357,790.00	16,500,000.00
Devlet Tahvili Repo	TRT240724T15	31/05/19-03/06/19	22,111,110.00	14,500,000.00
TOPLAM :			311,055,320.00	302,500,000.00
Finansman Bonosu	TRFISFN71947	10/05/2019	1,000,000.00	958,140.00
Finansman Bonosu	TRFKORT81943	22/05/2019	200,000.00	185,892.44
Finansman Bonosu	TRFHYTVK1913	24/05/2019	500,000.00	500,000.00
Finansman Bonosu	TRFKORT81935	28/05/2019	300,000.00	282,237.59
Finansman Bonosu	TRFKORT81935	30/05/2019	500,000.00	470,995.70
TOPLAM :			2,500,000.00	2,397,265.73
Özel Sektör Tahvili	TRSDEVA52119	06/05/2019	10,000.00	10,000.00
Özel Sektör Tahvili	TRSDEVA52119	06/05/2019	10,000.00	10,000.00
Özel Sektör Tahvili	TRSDEVA52119	15/05/2019	500,000.00	502,972.08
Özel Sektör Tahvili	TRSDEVA52119	15/05/2019	900,000.00	905,349.75
Özel Sektör Tahvili	TRSDEVA52119	15/05/2019	600,000.00	603,566.50
Özel Sektör Tahvili	TRSDEVA52119	22/05/2019	400,000.00	404,235.85
Özel Sektör Tahvili	TRSPDG52014	22/05/2019	300,000.00	301,769.78
Özel Sektör Tahvili	TRSDEVA52119	23/05/2019	500,000.00	505,624.49
Özel Sektör Tahvili	TRSMGTI22115	23/05/2019	500,000.00	532,815.52
Özel Sektör Tahvili	TRSMPLC61916	23/05/2019	500,000.00	516,425.55
Özel Sektör Tahvili	TRSPDG52014	24/05/2019	500,000.00	503,682.04
Özel Sektör Tahvili	TRSDEVA52119	27/05/2019	500,000.00	506,958.19
Özel Sektör Tahvili	TRISGYK1917	28/05/2019	40,000.00	40,032.07
Özel Sektör Tahvili	TRSHKTA2014	29/05/2019	450,000.00	472,162.13
Özel Sektör Tahvili	TRSMGTI22115	29/05/2019	400,000.00	400,640.00
Özel Sektör Tahvili	TRSORFN72013	29/05/2019	500,000.00	504,784.77
Özel Sektör Tahvili	TRSPDG52014	29/05/2019	500,000.00	505,505.56
Özel Sektör Tahvili	TRSAKFH12015	30/05/2019	500,000.00	515,330.71
Özel Sektör Tahvili	TRSDEVA52119	30/05/2019	500,000.00	507,962.22
Özel Sektör Tahvili	TRSYDAT32212	30/05/2019	500,000.00	522,311.95
Özel Sektör Tahvili	TRSZORN71914	30/05/2019	400,000.00	410,909.65
Özel Sektör Tahvili	TRSERGL52117	31/05/2019	5,500,000.00	5,500,000.00
TOPLAM :			14,510,000.00	14,683,038.81

10- ÖDÜNC İŞLEMLERİ:				
Verilen Ödünçler	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal Değeri	Tutar
TOPLAM :			0	0
Alınan Ödünçler				
TOPLAM :			0	0