

OYAK PORTFÖY KISA VADELİ KİRA SERTİFİKASI KATILIM FONU
01/12/2019 - 31/12/2019 TARİHLERİ ARASI FON RAPORU

1- FONU TANITICI BİLGİLER	
A. FONUN ADI:	OTF-OYAK PORTFÖY KISA VADELİ KİRA SERTİFİKASI KATILIM 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:	299,667,892.57
F. DOLAŞIMDAKİ PAY:	226,664,095.00
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	08/10/2017
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER	
A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	1.322079
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	1.311764
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	0.79%
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	18.10%
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	18.10%
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
Hisse Senedi	
Varant	
Devlet Tahvili	
Özel Sektör Tahvili	
Finansman Bonosu	
Banka Bonosu	
Hazine Bonosu	
Devlet Tahvili Repo	
Kuponlar Repo	
Hazine Bonosu Repo	
Varlığa Dayalı Menkuller	
Kira Sertifikaları	87.89%
Katılım Hesabı	12.11%
Katılma Belgesi	
GES	
GOS	
Borsa Para Piyasası	
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:	3.98%
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	106.00%
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	61.212
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:	477,358,143.86
T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	405,585,956.80

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) VARANTLAR:			
C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:			
D) BANKA BONOLARI:			
E) FİNANSMAN BONOLARI:			
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:			
G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:			
H) GELİRE ENDEKSİ SENETLER:			
I) KİRA SERTİFİKALARI:			
TRD120220T16	14,330,000.00	15,083,765.16	5.09%
TRDBRKT12031	5,700,000.00	5,839,659.69	1.97%
TRDBRKT22014	2,000,000.00	2,080,511.20	0.70%
TRDBRKT22022	7,800,000.00	7,949,956.56	2.68%
TRDBRKT22030	5,120,000.00	5,188,796.93	1.75%
TRDBRKT32021	12,000,000.00	12,044,551.20	4.07%
TRDBRKT42012	18,000,000.00	18,166,870.80	6.13%
TRDHVKA12014	3,520,000.00	3,783,277.34	1.28%
TRDHVKA22013	5,390,000.00	5,564,601.50	1.88%
TRDHVKA22013	10,000.00	10,323.94	0.00%
TRDHVKA22021	5,000,000.00	5,146,011.50	1.74%
TRDHVKA32020	8,000,000.00	8,294,944.80	2.80%
TRDHVKA42011	4,990,000.00	5,060,317.58	1.71%
TRDHVKA52010	2,100,000.00	2,109,226.35	0.71%
TRDHVKA52028	4,000,000.00	4,007,564.00	1.35%
TRDHVKA62019	5,210,000.00	5,221,940.80	1.76%
TRDKTLM22014	5,000,000.00	5,091,060.50	1.72%
TRDKTVK12018	14,750,000.00	15,172,733.53	5.12%
TRDKTVK12026	9,500,000.00	9,683,496.30	3.27%
TRDKTVK12034	7,000,000.00	7,104,727.70	2.40%
TRDKTVK22017	14,000,000.00	14,049,590.80	4.74%
TRDTFVK22017	9,485,891.00	9,626,309.70	3.25%
TRDTFVK22025	10,000,000.00	10,076,182.00	3.40%
TRDTFVK32016	10,000,000.00	10,043,698.00	3.39%
TRDVVRK12043	3,000,000.00	3,076,681.20	1.04%
TRDVVRK22018	7,500,000.00	7,648,077.00	2.58%
TRDVVRK22026	6,000,000.00	6,061,825.20	2.05%
TRDVVRK32017	1,000,000.00	1,003,552.80	0.34%
TRDYVKA2119	1,000,000.00	1,002,232.00	0.34%
TRDZKVK12023	5,000,000.00	5,154,159.50	1.74%
TRDZKVK22014	15,010,000.00	15,275,525.40	5.16%
TRDZKVK32013	15,200,000.00	15,366,985.68	5.19%
TRDZKVK42012	17,000,000.00	17,022,769.80	5.75%
TOPLAM :	253,615,891.00	258,011,926.46	87.13%
J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:			
K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:			
L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:			
M) KATILIM HESAPLARI:			
	4,041,950.68	4,035,594.52	1.36%
	2,122,939.68	2,119,750.36	0.72%
	2,669,007.88	2,661,837.80	0.90%
	3,765,134.32	3,755,721.32	1.27%
	2,127,703.26	2,118,090.91	0.72%
	3,032,136.99	3,014,178.08	1.02%
	4,042,849.32	4,017,643.84	1.36%
	3,097,966.39	3,078,614.61	1.04%
	3,528,328.90	3,507,310.68	1.18%
	3,100,541.61	3,078,876.21	1.04%
	3,129,909.31	3,106,398.12	1.05%
	2,108,497.25	2,093,986.50	0.71%
	1,545,054.23	1,530,669.94	0.52%
TOPLAM :	38,312,019.82	38,118,672.89	12.87%
N) KATILMA BELGELERİ:			
O) VOB İŞLEMLERİ:			
P) OPSİYON İŞLEMLERİ:			
R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:			
S) DÖVİZE ENDEKSİ TAHVİLLER:			
T) DİĞER:			
FON PORTFÖY DEĞERİ	291,927,910.82	296,130,599.35	

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:		
	Tutarı	%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	296,130,599.35	98.82%
B. HAZİR DEĞERLER (+) :	3,978,867.83	1.33%
C. ALACAKLAR (+) :	0.00	0.00%
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0	0.00%
E. BORÇLAR (-) :	441,574.61	0.15%
FON TOPLAM DEĞERİ:	299,667,892.57	

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	
Açıklama	Tutarı
37001Fon Yönetim Ücreti	402,766.20
37002Denetim Ücreti	2,657.76
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	2,981.72
37005Vergi, Resim ve Harçlar	48.00
37006Saklama Giderleri	22,661.68
37008Banka Masrafları	1,567.86
37009Noter Tasdik ve Tescil Gideri	200.52
37021Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	14,984.16
37030E-Defter ve E-Fatura Bakım Bedeli Gideri	302.23
37056Vergi Beyannameleri SMMM Ücreti	400.02
37098Küsürat farkları	1.14
TOPLAM	448,571.29

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

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR:				
Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Satış Tarihi	Nominal Değeri	Satış Değeri
Kira Sertifikaları	TRDZKVKA1928	05/12/2019	5,700,000.00	5,877,917.24
Kira Sertifikaları	TRDTFVKA1923	10/12/2019	2,000,000.00	2,065,036.34
Kira Sertifikaları	TRDTFVKA1923	11/12/2019	4,900,000.00	5,061,040.62
Kira Sertifikaları	TRDBRKT22022	12/12/2019	2,000,000.00	2,025,051.25
Kira Sertifikaları	TRDBRKT22022	12/12/2019	750,000.00	759,394.22
Kira Sertifikaları	TRDBRKT22022	12/12/2019	1,000,000.00	1,012,525.63
Kira Sertifikaları	TRDBRKT22022	12/12/2019	250,000.00	253,131.41
Kira Sertifikaları	TRDKTVKA1918	12/12/2019	3,000,000.00	3,068,847.46
Kira Sertifikaları	TRDZKVKA22014	12/12/2019	5,000,000.00	5,052,158.84
Kira Sertifikaları	TRDZKVKA1928	12/12/2019	2,000,000.00	2,068,190.39
Kira Sertifikaları	TRDTFVK22017	17/12/2019	420,000.00	424,192.46
Kira Sertifikaları	TRDHVKA42011	18/12/2019	510,000.00	514,851.88
Kira Sertifikaları	TRDTFVK22017	26/12/2019	1,000,000.00	1,012,817.62
Kira Sertifikaları	TRDBRKT42012	30/12/2019	5,000,000.00	5,047,837.44
Kira Sertifikaları	TRDTFVK22017	30/12/2019	5,000,000.00	5,070,339.36
Kira Sertifikaları	TRDTFVK22017	31/12/2019	5,500,000.00	5,579,711.15

8- İTFAALAR			
Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal Değeri	
TRDBRKA1915	04/12/2019	7,000,000.00	
TRDTFVKA1931	06/12/2019	10,000,000.00	
TRDZKVA1910	06/12/2019	15,300,000.00	
TRDTFVKA1915	17/12/2019	6,000,000.00	
TRDTFVKA1923	17/12/2019	9,590,000.00	
TRDHVKA1914	17/12/2019	2,100,000.00	
TRDKTVKA1918	18/12/2019	14,000,000.00	
TRDBRKA1923	20/12/2019	5,000,000.00	
TRDZKVA1928	27/12/2019	16,000,000.00	

9- PORTFÖYE ALIŞLAR:				
Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Alış Tarihi-G.D.Tarihi	Nominal Değeri	Alış Değeri
Katılım Hesabı		04/12/2019	4,000,000.00	4,000,000.00
Katılım Hesabı		06/12/2019	2,103,165.89	2,103,165.89
Katılım Hesabı		09/12/2019	2,643,514.26	2,643,514.26
Katılım Hesabı		09/12/2019	3,731,665.88	3,731,665.88
Katılım Hesabı		16/12/2019	2,108,478.56	2,108,478.56
Katılım Hesabı		17/12/2019	3,000,000.00	3,000,000.00
Katılım Hesabı		18/12/2019	4,000,000.00	4,000,000.00
Katılım Hesabı		23/12/2019	3,071,042.18	3,071,042.18
Katılım Hesabı		24/12/2019	3,500,000.00	3,500,000.00
Katılım Hesabı		24/12/2019	3,072,209.94	3,072,209.94
Katılım Hesabı		24/12/2019	3,099,163.91	3,099,163.91
Katılım Hesabı		27/12/2019	2,091,299.32	2,091,299.32
Katılım Hesabı		30/12/2019	1,529,798.16	1,529,798.16
TOPLAM :			37,950,338.10	37,950,338.10
Kira Sertifikaları	TRDZKVA1928	02/12/2019	1,500,000.00	1,545,434.98
Kira Sertifikaları	TRDBRKT22030	03/12/2019	910,000.00	913,066.63
Kira Sertifikaları	TRDBRKT22030	03/12/2019	690,000.00	692,325.24
Kira Sertifikaları	TRDZKVA1928	03/12/2019	2,800,000.00	2,885,524.63
Kira Sertifikaları	TRDBRKT22030	04/12/2019	1,470,000.00	1,475,978.76
Kira Sertifikaları	TRDBRKT22030	04/12/2019	300,000.00	301,070.16
Kira Sertifikaları	TRDBRKT42012	04/12/2019	7,000,000.00	7,000,000.00
Kira Sertifikaları	TRDHVKA22013	04/12/2019	60,000.00	61,296.76
Kira Sertifikaları	TRDTFVKA1915	04/12/2019	6,000,000.00	6,651,919.11
Kira Sertifikaları	TRDTFVK22025	06/12/2019	10,000,000.00	10,000,000.00
Kira Sertifikaları	TRDZKVK32013	06/12/2019	15,000,000.00	15,000,000.00
Kira Sertifikaları	TRDZKVA1928	06/12/2019	2,200,000.00	2,269,383.76
Kira Sertifikaları	TRDZKVA1928	09/12/2019	900,000.00	929,305.47
Kira Sertifikaları	TRDTFVKA1923	12/12/2019	5,000,000.00	5,166,113.47
Kira Sertifikaları	TRDZKVK22014	12/12/2019	5,000,000.00	5,052,158.84
Kira Sertifikaları	TRDTFVKA1923	13/12/2019	1,900,000.00	1,963,782.91
Kira Sertifikaları	TRDZKVA1928	13/12/2019	2,100,000.00	2,172,239.40
Kira Sertifikaları	TRDHVKA32020	16/12/2019	3,000,000.00	3,085,861.02
Kira Sertifikaları	TRDHVKA32020	16/12/2019	2,000,000.00	2,057,240.68
Kira Sertifikaları	TRDZKVK12023	16/12/2019	2,000,000.00	2,051,037.81
Kira Sertifikaları	TRD120220T16	17/12/2019	2,790,000.00	2,924,146.88
Kira Sertifikaları	TRD120220T16	17/12/2019	2,210,000.00	2,316,480.71
Kira Sertifikaları	TRD120220T16	17/12/2019	680,000.00	712,763.30
Kira Sertifikaları	TRD120220T16	17/12/2019	320,000.00	335,418.02
Kira Sertifikaları	TRDBRKT22030	17/12/2019	200,000.00	201,652.33
Kira Sertifikaları	TRDBRKT22030	17/12/2019	50,000.00	50,413.08
Kira Sertifikaları	TRDBRKT42012	17/12/2019	3,000,000.00	3,014,426.23
Kira Sertifikaları	TRDBRKT42012	17/12/2019	2,000,000.00	2,009,617.49
Kira Sertifikaları	TRDHVKA52010	17/12/2019	2,100,000.00	2,100,000.00
Kira Sertifikaları	TRDTFVK32016	17/12/2019	10,000,000.00	10,000,000.00
Kira Sertifikaları	TRD120220T16	18/12/2019	1,920,000.00	2,010,299.08
Kira Sertifikaları	TRD120220T16	18/12/2019	200,000.00	209,406.15
Kira Sertifikaları	TRD120220T16	18/12/2019	2,880,000.00	3,019,480.62
Kira Sertifikaları	TRD120220T16	18/12/2019	2,000,000.00	2,096,861.54
Kira Sertifikaları	TRDBRKT42012	18/12/2019	150,000.00	150,810.49
Kira Sertifikaları	TRDBRKT42012	18/12/2019	5,850,000.00	5,881,609.09
Kira Sertifikaları	TRDHVKA22013	18/12/2019	80,000.00	82,158.59
Kira Sertifikaları	TRDKTVK12026	18/12/2019	9,500,000.00	9,654,903.20
Kira Sertifikaları	TRDKTVK12034	18/12/2019	5,000,000.00	5,056,888.89
Kira Sertifikaları	TRDKTVK22017	18/12/2019	14,000,000.00	14,000,000.00
Kira Sertifikaları	TRDTFVK22017	18/12/2019	420,000.00	424,324.78
Kira Sertifikaları	TRDZKVA1928	18/12/2019	500,000.00	517,956.16
Kira Sertifikaları	TRD120220T16	19/12/2019	330,000.00	346,031.47
Kira Sertifikaları	TRDBRKT22030	19/12/2019	1,500,000.00	1,514,169.24
Kira Sertifikaları	TRDVVRK22018	19/12/2019	500,000.00	507,789.04
Kira Sertifikaları	TRDVVRK32017	19/12/2019	1,000,000.00	1,000,000.00
Kira Sertifikaları	TRDZKVK32013	19/12/2019	200,000.00	201,281.37
Kira Sertifikaları	TRDBRKT22022	20/12/2019	2,000,000.00	2,031,256.25
Kira Sertifikaları	TRDBRKT22022	20/12/2019	1,000,000.00	1,015,628.12
Kira Sertifikaları	TRDBRKT22022	20/12/2019	800,000.00	812,502.50
Kira Sertifikaları	TRDBRKT32021	20/12/2019	12,000,000.00	12,000,000.00
Kira Sertifikaları	TRD120220T16	23/12/2019	1,000,000.00	1,049,778.02
Kira Sertifikaları	TRDBRKT12031	24/12/2019	3,000,000.00	3,082,527.03
Kira Sertifikaları	TRDHVKA62019	24/12/2019	5,210,000.00	5,210,000.00
Kira Sertifikaları	TRDHVKA52028	26/12/2019	4,000,000.00	4,000,000.00
Kira Sertifikaları	TRDHVKA42011	27/12/2019	500,000.00	506,228.50
Kira Sertifikaları	TRDTFVK22017	27/12/2019	1,000,000.00	1,013,122.68
Kira Sertifikaları	TRDYVKA52119	27/12/2019	1,000,000.00	1,000,000.00
Kira Sertifikaları	TRDZKVA42012	27/12/2019	17,000,000.00	17,000,000.00
Kira Sertifikaları	TRDBRKT42012	30/12/2019	5,000,000.00	5,047,837.44
Kira Sertifikaları	TRDZKVK22014	30/12/2019	10,000.00	10,171.86
Kira Sertifikaları	TRDHVKA22013	31/12/2019	10,000.00	10,320.09

TOPLAM :			192,740,000.00	195,401,999.87
----------	--	--	----------------	----------------

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