

ZİRAAT PORTFÖY BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

**1 OCAK - 31 ARALIK 2020 HESAP DÖNEMİNE AİT
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**



ZİRAAT PORTFÖY 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

Ziraat Portföy Borçlanma Araçları Fonu'nun ("Fon") pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 31 Aralık 2020 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 2020 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

Ziraat Portföy Borçlanma Araçları Fonu'nun pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden 31 Aralık 2020 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 Ziraat Portföy Yönetimi A.Ş.'nin bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka bir maksatla kullanılması mümkün değildir.

Fon'un önceki döneme ait Pay Fiyatının Hazırlanmasına 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 30 Nisan 2020 tarihli raporda söz konusu fiyat raporlarının Tebliğ hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlandığı belirtilmiştir.

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



Zeynep Uras, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 28 Nisan 2021

ZİRAAT PORTFÖY BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

İÇİNDEKİLER	SAYFA
I- FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU FİYAT RAPORLARI.....	1-2
II- TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ TABLOSU.....	3

ZİRAAT PORTFÖY BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

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

	İhraççı	Vade	ISIN Kodu	Nominal Faiz Oranı	Faiz Ödeme Sayısı	Nominal Değer(1)	Birim Ağız Fiyatı(2)	Satın Alış Tarihi (3)	İç İskonto Oranı	Borsa Süzleşme No(4)	Repo Teminat Tutarı(5)	Günlük Birim Değer	Toplam Değer/Net Varlık Değeri	Grup (%)	Toplam (%)
A. BORÇLANMA ARAÇLARI															
A.1. ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI															
Varlığa Dayalı Menkul Kıymet															
	TKYB 1.Varlık Finansmanı Fonu	07.12.2023	TRPKYVFA2318	12,32	868	2.000.000	111,837	-	12,9	-	-	112,7722	2.255.445	3,71	3,42
ARA GRUP TOPLAMI						2.000.000							2.255.445	3,71	3,42
Finansman Bonosu															
	AKBANK TAS	20.01.2021	TRFAKBK12148	15,35	19	2.000.000	94,569	-	16,51	-	-	99,2053	1.984.107	3,26	3,01
	DENİZBANK A.Ş.	10.06.2021	TRFDZBK62111	18,94	160	2.000.000	91,346	-	19,96	-	-	92,3131	1.846.263	3,04	2,80
	NUROL YATIRIM BANKASI AŞ	28.01.2021	TRFNURL12128	13,94	27	1.000.000	95,347	-	14,88	-	-	98,9762	989.762	1,63	1,50
	TÜRK EKONOMİ BANKASI AŞ	12.03.2021	TRFTEBK32123	9,43	70	2.000.000	100,000	-	9,76	-	-	100,5375	2.010.749	3,31	3,05
	T.HALK BANKASI AŞ	07.01.2021	TRFTHAL12136	14,36	6	2.000.000	100,000	-	15,22	-	-	102,9160	2.058.321	3,39	3,12
	ZORLU ENERJİ	12.02.2021	TRFZORN22112	19,91	42	1.500.000	99,416	-	21,49	-	-	101,7769	1.526.654	2,51	2,32
ARA GRUP TOPLAMI						10.500.000							10.415.855	17,13	15,80
A.2. KAMU SEKTÖRÜ BORÇLANMA ARAÇLARI															
Devlet Tahvil															
	HAZINE	08.03.2028	TRT080328T15	12,55	1742	20.000	98,002	-	12,95	-	-	102,8954	20.579	0,03	0,03
	HAZINE	11.02.2026	TRT110226T13	12,42	1413	27.000	87,059	-	12,81	-	-	97,1382	26.227	0,04	0,04
	HAZINE	11.08.2027	TRT110827T16	12,47	1694	100.000	83,517	-	12,86	-	-	95,1466	95.147	0,16	0,14
	HAZINE	14.09.2022	TRT140922T17	14,27	575	1.000.000	92,573	-	14,78	-	-	93,9856	939.856	1,55	1,43
	HAZINE	17.02.2021	TRT170221T12	14,13	47	300.000	100,421	-	15,03	-	-	103,4628	310.388	0,51	0,47
	HAZINE	18.01.2023	TRT180123T10	13,90	646	2.088.000	103,835	-	14,38	-	-	102,5008	2.140.217	3,52	3,25
	HAZINE	18.10.2023	TRT181023T19	13,37	816	2.000.000	116,713	-	13,82	-	-	119,2134	2.384.267	3,92	3,62
	HAZINE	21.04.2021	TRT210421T14	14,68	110	1.500.000	103,981	-	15,44	-	-	105,7587	1.586.381	2,61	2,41
	HAZINE	21.07.2021	TRT210721T11	0,47	201	1.500.000	249,379	-	0,47	-	-	262,6592	3.939.888	6,48	5,98
	HAZINE	22.09.2021	TRT220921T18	15,77	256	4.500.000	97,681	-	16,39	-	-	98,1429	4.416.431	7,27	6,70
	HAZINE	24.07.2024	TRT240724T15	13,03	1082	3.200.000	92,305	-	13,46	-	-	92,6141	2.963.652	4,88	4,50
	HAZINE	26.01.2022	TRT260122T11	15,27	26	1.700.000	99,768	-	16,17	-	-	102,9991	1.750.985	2,88	2,66
	HAZINE	27.09.2023	TRT270923T11	13,72	882	3.000.000	89,509	-	14,2	-	-	91,2573	2.737.718	4,50	4,15
ARA GRUP TOPLAMI						20.935.000							23.311.737	38,35	35,36
GRUP TOPLAMI						57.045.000							60.788.858	100,00	92,21

ZİRAAT PORTFÖY BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

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

B. KİRA SERTİFİKALARI

	ZİRAAT KATILIM BANKASI A.Ş.	19.03.2021	TRDZKVK32120	15,58	77	2.000.000	100,000	-	16,51	-	-	101,0008	2.020.016	100,00	3,06
GRUP TOPLAMI						2.000.000							2.020.016	100,00	3,06

C. DİĞER VARLIKLAR

C.1. Ters Repolar

	-	04.01.2021	TRT080328T15	11,42	3	130.163	103,201	31.12.2020	12,09	-	125968	103,2331	130.041	5,40	0,20
ARA GRUP TOPLAMI						130.163							130.041	5,40	0,20

C.2. Katılma Payı

	ARZ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.	-	AZ1	-	-	928.378	2,178	-	-	-	-	2,4515	2.275.926	94,60	3,45
ARA GRUP TOPLAMI						928.378							2.275.926	94,60	3,45
GRUP TOPLAMI						1.058.541							2.405.967	100,00	3,65

D.TÜREV ARAÇLAR

Nakit Teminatlar

	-	-	-	-	-	836.535	-	-	-	-	-	-	836.535	100,00	1,27
GRUP TOPLAMI						836.535							836.535	100,00	1,27

FON/ORTAKLIK PORTFÖY DEĞERİ

66.051.375 **100,19**

ZİRAAT PORTFÖY BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

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

	31 Aralık 2020		
	Tutar TL	Grup %	Toplam %
Fon/Ortaklık Portföy Değeri	66.051.375	100,00	100,19
Hazır Değerler	8.769	100,00	0,01
Kasa	-	-	-
Bankalar	8.769	100,00	0,01
Diğer Hazır Değerler	-	-	-
Alacaklar			
Takastan Alacaklar	-	-	-
Diğer Alacaklar	-	-	-
Diğer Varlıklar	-	-	-
Borçlar	(135.912)	100,00	(0,21)
Takasa Borçlar			
Yönetim Ücreti	(113.673)	83,64	(0,17)
Ödenecek Vergi	-	-	-
İhtiyatlar	-	-	-
Krediler	-	-	-
Diğer Borçlar	(22.239)	16,36	(0,03)
Toplam Değer/Net Varlık Değeri	65.924.232		100,00
Toplam Katılma Payı/Pay Sayısı	17.000.000.000		
Yatırım Fonları İçin Kurucu Tarafından İktisap Edilen Katılma	14.916.693.467		