

ZBK-ORTA VADELİ BORÇ
EYLÜL - 2019 AYLIK RAPORU

1 - FONU TANITICI BİLGİLER

A - FONUN ADI	: ZBK-ZİRAAT PORTFÖY ORTA VAD BORÇLANMA ARAÇLARI FON
B - KURUCUNUN ÜNVANI	: ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C - YÖNETİCİNİN ÜNVANI	: ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D - FON TUTARI	: 500.000,00
E - FON TOPLAM DEĞERİ	: 80.613.518,52
F - TEDAVÜLDEKİ PAY SAYISI	: 319.395,000
G - FONUN KURULUŞ TARİHİ	: 06.11.1989
H - FONUN SÜRESİ	: SÜRESİZ

2 - FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A - AY SONU PAY FİYATI	: 252,114481
B - ÖNCEKİ AY PAY FİYATI	: 247,400078
C - AYLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI	: 1,905579
D - YIL BAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	: 19,366686
E - YILLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI	: 26,684071
F - AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	
Ters Repo	: 9,248336
Devlet Tahvilleri	: 47,172917
Hazine Bonoları	: 1,898174
Özel Sektör Tahvilleri	: 24,535500
Vadeli Mevduat	: 1,398289
VOB Nakit Teminatı	: 0,838836
Katılma Payları	: 5,483811
Diğer	: 9,424137
G - AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 0,000318
H - AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	: 15,576042
I - PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 326,090601

3 - FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

A - HİSSE SENETLERİ	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
1. Banka İştirak ve Hissedarları			
2. Diğer Ortaklıklar			
B - DEVLET TAHVİLİ ve HAZİNE BONOLARI	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
11.08.2027 TRT110827T16	100.000	88.384,92	0,109442
12.08.2020 TRT120820T12	1.500.000	1.661.130,91	2,056884
17.02.2021 TRT170221T12	2.000.000	1.958.714,51	2,425365
13.11.2019 TRT131119T19	3.700.000	3.879.054,51	4,803213
15.01.2020 TRT150120T16	1.300.000	1.316.868,43	1,630603
15.01.2020 TRT150120T32	4.000.000	3.849.314,19	4,766387
24.07.2024 TRT240724T15	100.000	86.788,51	0,107465
08.03.2028 TRT080328T15	20.000	19.218,58	0,023797
13.05.2020 TRT130520T14	2.000.000	1.838.946,04	2,277062
16.09.2020 TRT160920T25	4.000.000	3.534.884,68	4,377047
22.09.2021 TRT220921T18	500.000	465.545,32	0,576458
07.10.2020 TRT071020T23	3.000.000	2.608.780,30	3,230304
11.12.2019 TRT111219T10	2.000.000	1.949.127,25	2,413494
18.01.2023 TRT180123T10	88.000	87.327,91	0,108133
05.02.2020 TRT050220T17	5.900.000	5.842.941,26	7,234982
08.07.2020 TRT080720T19	3.600.000	3.576.387,23	4,428437
10.06.2020 TRT100620T16	8.500.000	7.765.398,82	9,615452
11.02.2026 TRT110226T13	27.000	24.182,23	0,029943
C - TERS REPO	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
1 01.10.2019	8.003.562	8.003.561,64	9,910356
2 01.10.2019	6.002	6.002,22	0,007432
D - GELİR ORTAKLIĞI SENEDİ	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
E - DÖVİZE ENDEKSİLİ TAHVİLLER	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
F - FİNANSMAN BONOLARI	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
G - ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
04.10.2019 TRFDZYOE1916	1.900.000	1.897.079,50	2,349046
19.02.2021 TRSOPAS22129	1.000.000	1.029.009,74	1,274164
22.07.2020 TRSYDAT72010	400.000	412.644,57	0,510954
11.03.2020 TRFDZBK32023	1.000.000	1.009.702,83	1,250258
06.03.2020 TRFTCZB32018	790.000	799.459,72	0,989926
11.01.2021 TRSBOLU12115	1.000.000	1.053.556,97	1,304560
16.07.2020 TRSMGTI72011	910.000	949.594,90	1,175829

27.11.2019	TRFBVYSK1910	800.000	818.041,86	1,012935
10.12.2027	TRSSKBKA2716	3.020.000	2.963.112,83	3,669054
14.09.2029	TRSVKFB92925	1.100.000	1.102.108,37	1,364678
21.02.2020	TRFZORN22021	500.000	512.168,79	0,634190
17.06.2021	TRSKALE62114	5.000.000	4.961.534,42	6,143586
27.08.2020	TRFTCZB82013	1.000.000	1.017.446,51	1,259846
06.03.2020	TRSNURL32020	1.000.000	915.237,21	1,133286
04.02.2020	TRSHYTV22012	750.000	772.357,22	0,956366
24.02.2021	TRSMGTI22115	500.000	512.427,35	0,634510
26.02.2020	TRFTHAL22010	3.000.000	3.043.977,29	3,769184
07.09.2020	TRSDANA92011	1.600.000	1.596.110,00	1,976372
25.01.2021	TRSIGSY12113	220.000	226.493,77	0,280454
10.09.2021	TRSORFN92110	300.000	303.849,85	0,376240
11.11.2019	TRFVFASK1914	240.000	235.516,16	0,291626
H - YABANCI MENKUL KIYMETLER	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)	
I - ALTIN VE DİĞER DEĞERLİ MADENLER	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)	
İ - VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)	
J - BORSA PARA PİYASASI SATIŞ	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)	
K - GELİRE ENDEKSİ SENETLER	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)	
L - OPSİYON SÖZLEŞMELERİ	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)	
M - VOB SÖZLEŞMELERİ	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)	
N - VOB NAKİT TEMİNATI	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)	
30.09.2019 TL	672.279	672.278,52	0,832444	
O - KİRA SERTİFİKASI KIYMETLER	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)	
P - EUROBOND	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)	
R - VADELİ MEVDUAT	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)	
04.10.2019 3AyaKadarVD-TCZ-TRY	1.022.192	1.020.697,12	1,263871	
S - KATILIM HESABI	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)	
V - ALTIN KATILIM HESABI	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)	
Ş-DÖVİZ KATILIM HESABI	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)	
(%)				
T - ALTIN VADELİ MEVDUAT	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)	
U - REPO	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)	
Y - KATILMA PAYLARI	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)	
30.09.2019 AZ1	748.303	1.718.189,74	2,127537	
30.09.2019 AZ2	1.565.913	2.654.424,54	3,286823	
Z - Satış Vaadiyle Alış	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)	
AA - Alış Vaadiyle Satış	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)	

4 - FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

	Tutar	Oran (%)
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	80.759.579,25	100,181186
B. HAZIR DEĞERLER	414,19	0,000514
a) Kasa	0,00	0,000000
b) Bankalar	414,19	0,000514
c) Hazır Değerler	0,00	0,000000
C. ALACAKLAR	0,00	0,000000
a) Takastan Alacaklar T1	0,00	0,000000
b) Takastan Alacaklar T2	0,00	0,000000
c) Takastan Alacaklar	0,00	0,000000
d) Temettü Alacakları	0,00	0,000000
e) Diğer Alacaklar	0,00	0,000000
f) Takastan Alacaklar(Metal-Altın)	0,00	0,000000
g) Diğer Alacaklar(Opsiyon)	0,00	0,000000
h) Takasbank Dışı İşlemlerden Alacaklar	0,00	0,000000
D. DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,000000
a) Cari Yıl Peşin Ödenmiş Vergiler	0,00	0,000000
b) Geçmiş Yıl Peşin Ödenmiş Vergiler	0,00	0,000000
E. BORÇLAR	146.474,92	0,181700
a) Takasa Borçlar T1	0,00	0,000000
j) SPK Kayda Alma Ücreti	4.030,68	0,005000
k) Diğer Borçlar	15.742,92	0,019529
l) Takasa Borçlar(Metal Altın)	0,00	0,000000
m) Takasbank Dışı İşlemlerden Borçlar	0,00	0,000000
n) Borsa Kotundan Çıkarılan ÖST/ÖSB İçin Ayrılan Karşılık	0,00	0,000000
b) Takasa Borçlar T2	0,00	0,000000
c) Takasa Borçlar	0,00	0,000000
d) Yönetim Ücreti	126.701,32	0,157171
e) Vergi Yasal Yükümlülükler Karşılığı	0,00	0,000000
f) Ödenecek Vergi Resim Harçlar	0,00	0,000000
g) İhtiyatlar	0,00	0,000000
h) Krediler	0,00	0,000000
ı) Pay Geri Alışından Borçlar	0,00	0,000000
FON TOPLAM DEĞERİ	80.613.518,52	100,000000
Toplam Pay Sayısı	5.005.000.000,00	

Dolaşımdaki Pay Sayısı
FİYAT

319.395,000
252,394429

5 - AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

1 İhrac İzni Ücretleri	1.419,07
2 İlan Giderleri	0,00
3 Sigorta Ücretleri	0,00
4 Aracılık Komisyon Giderleri	2.577,26
4 Döviz aracılık komisyonları	0,00
5 Noter Harç ve Tasdik Ücretleri	0,00
6 Fon Yönetim Ücretleri	16.914,62
7 Vergi, Resim, Harç vb. Giderler	48,00
8 Metal Saklama Giderleri	0,00
8 Saklama Giderleri	1.592,27
9 Portföy Yönetim Ücreti	109.786,70
10 IMKB Endeksleri Lisans Ücreti	0,00
11 EFT Masrafı	590,79
12 Türev İşlemler Aracılık Komisyonu	612,64

6 - AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI, BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM, TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

Tarih	Kıymet Kodu	Nominal	Tutar	Oran Açıklama
03.09.2019	TRFMLPC91910	2.000.000,000	2.000.000,00	Anapara Ödemesi
03.09.2019	TRFFFKR91915	1.000.000,000	1.000.000,00	Anapara Ödemesi
04.09.2019	TRFNURL91916	1.500.000,000	1.500.000,00	Anapara Ödemesi
12.09.2019	TRFBVYS91910	1.100.000,000	1.100.000,00	Anapara Ödemesi
20.09.2019	TRFHEKT91910	1.000.000,000	1.000.000,00	Anapara Ödemesi
20.09.2019	TRFZORN91919	1.000.000,000	1.000.000,00	Anapara Ödemesi
24.09.2019	TRFOYMD91930	550.000,000	550.000,00	Anapara Ödemesi

7 - GEÇEN AY İÇİNDE YATIRIM FONLARINA İLİŞKİN MEVZUATTA MEYDANA GELEN DEĞİŞME VE HUKUKİ İHTİLAFLARLA İLGİLİ AÇIKLAMALAR

8 - PORTFÖYDEN SATIŞLAR

Türü	Vade Tarihi	Tanımı	Satış Tarihi	Nominal Değeri	Satış Değeri
	04.10.2019	TRFDZYOE1916	24.09.2019	100.000,000	99.488,93
HB	09.10.2019	TRB091019T16	24.09.2019	2.000.000,000	1.988.315,24

9 - İTFA

Türü	Vade Tarihi	Tanımı	İtfa Tarihi	Nominal Değeri	İtfa Değeri
	03.09.2019	TRFMLPC91910	03.09.2019	2.000.000,000	2.000.000,00
	03.09.2019	TRFFFKR91915	03.09.2019	1.000.000,000	1.000.000,00
	27.11.2019	TRFBVYSK1910	04.09.2019	800.000,000	18.717,84
	04.09.2019	TRFNURL91916	04.09.2019	1.500.000,000	1.500.000,00
	10.09.2021	TRSORFN92110	06.09.2019	300.000,000	20.017,20
	07.09.2020	TRSADNA92011	09.09.2019	1.600.000,000	104.323,20
	12.09.2019	TRFBVYS91910	12.09.2019	1.100.000,000	1.123.627,45
DT	08.03.2028	TRT080328T15	18.09.2019	20.000,000	1.240,00
	17.06.2021	TRSKALE62114	19.09.2019	5.000.000,000	299.000,00
	10.12.2027	TRSSKBA2716	20.09.2019	3.020.000,000	48.018,00
	20.09.2019	TRFHEKT91910	20.09.2019	1.000.000,000	1.061.387,00
	20.09.2019	TRFZORN91919	20.09.2019	1.000.000,000	1.000.000,00
	21.02.2020	TRFZORN22021	23.09.2019	500.000,000	12.527,50
	24.09.2019	TRFOYMD91930	24.09.2019	550.000,000	550.000,00
DT	22.09.2021	TRT220921T18	25.09.2019	500.000,000	23.000,00

10 - PORTFÖYE ALIŞLAR

Türü	Vade Tarihi	Tanımı	Alış Tarihi	Nominal Değeri	Alış Değeri
TRPO	01.10.2019	TRT060121T16	30.09.2019	2.635,000	6.000,00
TRPO	01.10.2019	TRT050220T17	30.09.2019	8.335.400,000	8.000.000,00
TRPO	30.09.2019	TRT060121T16	27.09.2019	215.556,000	490.000,00
TRPO	30.09.2019	TRT050220T17	27.09.2019	7.837.230,000	7.500.000,00
TRPO	27.09.2019	TRT060121T16	26.09.2019	89.792,000	204.000,00
TRPO	27.09.2019	TRT070727T13	26.09.2019	6.939.490,000	8.500.000,00

TRPO	26.09.2019	TRT060121T16	25.09.2019	39.637,000	90.000,00
TRPO	26.09.2019	TRT180924T11	25.09.2019	5.953.535,000	9.000.000,00
TRPO	25.09.2019	TRT060121T16	24.09.2019	44.065,000	100.000,00
TRPO	25.09.2019	TRT050220T17	24.09.2019	523.750,000	500.000,00
TRPO	25.09.2019	TRT050220T17	24.09.2019	8.903.655,000	8.500.000,00
TRPO	24.09.2019	TRT060121T16	23.09.2019	20.282,000	46.000,00
TRPO	24.09.2019	TRT111120T18	23.09.2019	972.500,000	1.000.000,00
TRPO	24.09.2019	TRT270923T11	23.09.2019	9.450.110,000	8.000.000,00
TRPO	23.09.2019	TRT060121T16	20.09.2019	79.056,000	179.000,00
TRPO	23.09.2019	TRT020823T11	20.09.2019	5.079.440,000	9.000.000,00
TRPO	20.09.2019	TRT060121T16	19.09.2019	70.704,000	160.000,00
TRPO	20.09.2019	TRT060825T15	19.09.2019	7.020.830,000	7.000.000,00
TRPO	19.09.2019	TRT060121T16	18.09.2019	148.120,000	335.000,00
TRPO	19.09.2019	TRT111120T18	18.09.2019	6.336.285,000	6.500.000,00
TRPO	18.09.2019	TRT060121T16	17.09.2019	167.227,000	378.000,00
TRPO	18.09.2019	TRT010420T19	17.09.2019	2.772.470,000	6.500.000,00
TRPO	17.09.2019	TRT060121T16	16.09.2019	153.600,000	347.000,00
TRPO	17.09.2019	TRT050624T35	16.09.2019	6.422.850,000	6.500.000,00
TRPO	16.09.2019	TRT060121T16	13.09.2019	162.285,000	366.000,00
TRPO	16.09.2019	TRT240724T15	13.09.2019	8.272.530,000	6.500.000,00
TRPO	13.09.2019	TRT060121T16	12.09.2019	56.787,000	128.000,00
TRPO	13.09.2019	TRT210421T14	12.09.2019	5.773.245,000	6.500.000,00
TRPO	12.09.2019	TRT060121T16	11.09.2019	189.103,000	426.000,00
TRPO	12.09.2019	TRT150120T16	11.09.2019	5.157.330,000	5.000.000,00
TRPO	11.09.2019	TRT060121T16	10.09.2019	163.449,000	368.000,00
TRPO	11.09.2019	TRT240724T15	10.09.2019	7.718.035,000	6.000.000,00
TRPO	10.09.2019	TRT060121T16	09.09.2019	123.545,000	278.000,00
TRPO	10.09.2019	TRT100124T17	09.09.2019	7.356.795,000	7.500.000,00
TRPO	09.09.2019	TRT060121T16	06.09.2019	89.478,000	201.000,00
TRPO	09.09.2019	TRT261022T10	06.09.2019	4.044.910,000	7.500.000,00
TRPO	06.09.2019	TRT060121T16	05.09.2019	199.992,000	449.000,00
TRPO	06.09.2019	TRT210721T11	05.09.2019	3.113.810,000	6.500.000,00
TRPO	05.09.2019	TRT060121T16	04.09.2019	115.874,000	260.000,00
TRPO	05.09.2019	TRT030523T13	04.09.2019	1.798.875,000	3.000.000,00
TRPO	05.09.2019	TRT020823T11	04.09.2019	1.997.190,000	3.500.000,00
TRPO	04.09.2019	TRT060121T16	03.09.2019	117.278,000	263.000,00
TRPO	04.09.2019	TRT110320T18	03.09.2019	6.495.985,000	7.000.000,00
TRPO	03.09.2019	TRT060121T16	02.09.2019	102.620,000	230.000,00
TRPO	03.09.2019	TRT210721T11	02.09.2019	1.917.305,000	4.000.000,00
	06.03.2020	TRFTCZB32018	06.09.2019	790.000,000	790.000,00
	11.03.2020	TRFDZBK32023	11.09.2019	1.000.000,000	1.000.000,00
DT	07.10.2020	TRT071020T23	24.09.2019	1.000.000,000	867.574,81
DT	07.10.2020	TRT071020T23	24.09.2019	1.500.000,000	1.301.362,21
DT	07.10.2020	TRT071020T23	24.09.2019	500.000,000	433.787,40
	26.02.2020	TRFTHAL22010	04.09.2019	3.000.000,000	3.000.000,00
DT	16.09.2020	TRT160920T25	10.09.2019	1.000.000,000	863.122,49
DT	16.09.2020	TRT160920T25	10.09.2019	1.000.000,000	863.198,42
	14.09.2029	TRSVKFB92925	27.09.2019	1.100.000,000	1.100.000,00