

YATIRIM FONLARI PORTFÖY DAĞILIM RAPORU

Rapor Dönemi 01/10/2018 ve 31/10/2018

I- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI: GARANTİ PORTFÖY İKİNCİ SERBEST (DÖVİZ) FON
B. KURUCUNUN ÜNVANI: GARANTİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C. YÖNETİCİNİN ÜNVANI: GARANTİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI: (TL) 100,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER: (TL) 18,286,954.57
E. KATILMA PAYI SAYISI : 3,510,143
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ: 16/07/2018
G. FONUN SÜRESİ: SÜRESİZ

II-FONUN PERFORMANS BİLGİLERİ

TL USD
A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI: 5.209746 0.947554
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI: 5.767555 0.962832
C.AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI: -9.67% -1.59%
Ç.YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:
D.YILLIK KATILMA PAYI FİYAT ARTIŞ ORANI:
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:
KAMU SEKTÖRÜ DIŞ BORÇLANMA ARACI 91.92%
TÜREV TEMİNAT 3.15%
YP MEVDUAT 4.93%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI: 0.04%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:
Hisse : 0.00%
Özel Borçlanma Araçları Devir Hızı : 0.00%
Kamu Borçlanma Araçları Devir Hızı : 0.00%
Kira Sertifikaları Devir Hızı : 0.00%
Yabancı Menkul Kıymetler Devir Hızı : 0.00%
Altın Devir Hızı : 0.00%
Varant Devir Hızı : 0.00%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ: 4792.185
H.KATILMA PAYI İHRÇ. NAKİT GİRİŞLERİ: 55,202.01
I.KATILMA PAYI İADE. NAKİT ÇIKIŞLARI:
J. AYLIK KORELASYON:
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON:

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nom.Değ(TL)	Rayiç.Değ(TL)	%
A.PAY			
B.BORÇLANMA ARAÇLARI			
B.1.ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI			
TAHVİL			
BONO			
FINANSMAN BONOSU			
GOS(GELİR ORT.SEN)			
GES(GELİRE END.SEN)			
VDMK(VAR DAY MEN K)			
DIŞ BORÇLANMA ARACI			
B.2.KAMU SEKTÖRÜ BORÇLANMA ARAÇLARI			
TAHVİL			
BONO			
FINANSMAN BONOSU			
GOS(GELİR ORT.SEN)			
GES(GELİRE END.SEN)			
VDMK(VAR DAY MEN K)			
DIŞ BORÇLANMA ARACI			
US900123AX87	200,000.00	1,139,804.51	6.23%
US900123BZ27	1,000,000.00	5,364,512.66	29.33%
US900123CK49	1,000,000.00	4,675,991.10	25.56%
US900123CM05	1,300,000.00	5,634,347.87	30.80%
Toplam	3,500,000.00	16,814,656.14	91.92%
Ara Grup Toplamı	3,500,000.00	16,814,656.14	91.92%
Ana Grup Toplamı	3,500,000.00	16,814,656.14	91.92%
C.KİRA SERTİFİKALARI			
KİRA SERTİFİKASI			
Ç.TÜREV ARAÇLAR			
TÜREV TEMİNAT			
VIOP-TL	561,063.15	575,940.65	3.15%
Toplam	561,063.15	575,940.65	3.15%
ALIM OPSİYONU			
Ç.1.VIOP OPSİYON			
VIOP ALIM OPSİYONU			
VIOP SATIM OPSİYONU			
Ana Grup Toplamı	561,063.15	575,940.65	3.14%
D.YABANCI SERMAYE PİYASASI ARAÇLARI			
YABANCI TAHVİL			
İKRAZ İŞT. SER			
YABANCI KİRA SER			
YP HİSSE			
BORSA YATIRIM FONLARI			
YP VARANT			
E.ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER			
KIYMETLİ MADEN			
F.VARANTLAR			
G.DİĞER VARLIKLAR			
TERS REPO			
REPO			
TAKASBANK BORSA PARA PİYASASI			
MEVDUAT			
YP MEVDUAT			

VADELİ	154,018.99	846,811.81	4.63%
VADELİ	10,000.62	54,984.41	0.30%
Toplam	164,019.61	901,796.22	4.93%
YATIRIM FONU			
GAYRİMENKUL SERTİFİKASI			
Ana Grup Toplamı	164,019.61	901,796.22	4.92%
FON PORTFOY DEĞERİ	4,225,082.76	18,292,393.01	

IV- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

	Tutarı (TL)	%	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	18,292,393.01	100.03%	
B. HAZİR DEĞERLER (+) :	15,966.32	0.09%	
C. ALACAKLAR (+) :	0.02		
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0		
E. BORÇLAR (-) :	21,404.78	0.12%	

FON TOPLAM DEĞERİ:	18,286,954.57
--------------------	---------------

V- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı (TL)
370.01.000-Fon Yönetim Ücreti	16,412.99
370.02.000-Denetim Ücreti	5,989.00
370.05.000-Vergi ve Resim Harç	38.8
370.06.000-Saklama Giderleri	1,404.24
370.07.000-İlan Giderleri	1,935.20
370.20.001-SPK Kayda Alma Mas	308.1
370.23.000-Futures İşlemi Kom	372.4
370.28.000-Portföy Saklama Gideri	1,312.89
370.33.000-Borsa Futures İşlemi Kom	214.75
370.99.000-Diger Giderler	169.63

TOPLAM	28,158.00
--------	-----------

VI- GEÇEN AY İÇİNDE

RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI
BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMİ
TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA
İLİŞKİN AÇIKLAMALAR
Açıklama

	Nominal (TL)
--	--------------

VII- PORTFÖYDEN SATIŞLAR

Sermaye Piyasası Aracı	İhraççı Kurum	Satış Tarihi	Nominal (TL)	Satış Değ. (TL)
------------------------	---------------	--------------	--------------	-----------------

VIII- İTFALAR

Sermaye Piyasası Aracı	İfta Tarihi	Nominal (TL)
------------------------	-------------	--------------

IX- PORTFÖYE ALIŞLAR

Sermaye Piyasası Aracı	İhraççı Kurum	Alış Tarihi-G.D.Tarihi	Nominal (TL)	Alış Değ. (TL)
------------------------	---------------	------------------------	--------------	----------------

X- ÖDÜNC İŞLEMLERİ

Sermaye Piyasası Aracı	Menkul Kıymet	İşlem-Vade Tarihi	Nominal	Cari Piyasa Değeri
------------------------	---------------	-------------------	---------	--------------------

XI- TÜREV ARAÇ İŞLEMLERİ

FUTURES SÖZLEŞMELERİ

Sermaye Piyasası Aracı	ISIN	İşlem Tarihi	Fiyat	Nominal	Cari Piyasa Değeri	Kısa/Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-23.10.2018	5.8246		12	69,895.20 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-23.10.2018	5.8249		14	81,548.60 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-23.10.2018	5.825		10	58,250.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-23.10.2018	5.8252		16	93,203.20 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-23.10.2018	5.8253		8	46,602.40 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-23.10.2018	5.8256		25	145,640.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-23.10.2018	5.8259		2	11,651.80 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-23.10.2018	5.826		5	29,130.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-23.10.2018	5.8262		12	69,914.40 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-23.10.2018	5.8266		25	145,665.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-23.10.2018	5.8267		17	99,053.90 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-23.10.2018	5.827		204	1,188,708.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-24.10.2018	5.7285		50	286,425.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-24.10.2018	5.7298		10	57,298.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-24.10.2018	5.7294		16	91,670.40 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-24.10.2018	5.7283		14	80,196.20 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-24.10.2018	5.728		3	17,184.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-24.10.2018	5.7279		57	326,490.30 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-26.10.2018	5.6222		29	163,043.80 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-26.10.2018	5.6206		200	1,124,120.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-26.10.2018	5.6204		121	680,068.40 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-26.10.2018	5.8042		67	388,881.40 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-26.10.2018	5.8049		183	1,062,296.70 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-31.10.2018	5.649		20	112,980.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-31.10.2018	5.648		10	56,480.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-31.10.2018	5.6462		50	282,310.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-31.10.2018	5.648		20	112,960.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-31.10.2018	5.6471		25	141,177.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-31.10.2018	5.647		25	141,175.00 Kısa

XII- PAY ALIM SATIM DEFTERİ

Toplam Pay Adedi	10,000,000,000.00
------------------	-------------------

Tarih	Pay Alışı	Pay Satışı	Alış Fiyatı	Satış Fiyatı	Dolaşımdaki Pay	Pay Döviz Kodu
01.10.2018			5.844256	5.767555		TL
01.10.2018			0.961986	0.962832	3,499,661.00	USD
02.10.2018			5.767555	5.720105		TL
02.10.2018			0.962832	0.9588	3,499,661.00	USD

03.10.2018	5.720105	5.699208	TL
03.10.2018	0.9588	0.948572	3,499,661.00 USD
04.10.2018	5.699208	5.704268	TL
04.10.2018	0.948572	0.946154	3,499,661.00 USD
05.10.2018	5.704268	5.725501	TL
05.10.2018	0.946154	0.934867	3,499,661.00 USD
08.10.2018	5.725501	5.754412	TL
08.10.2018	0.934867	0.935023	3,499,661.00 USD
09.10.2018	5.754412	5.732222	TL
09.10.2018	0.935023	0.931826	3,499,661.00 USD
10.10.2018	5.732222	5.73367	TL
10.10.2018	0.931826	0.937548	3,499,661.00 USD
11.10.2018	5.73367	5.716992	TL
11.10.2018	0.937548	0.938982	3,499,661.00 USD
12.10.2018	5.716992	5.646602	TL
12.10.2018	0.938982	0.943727	3,499,661.00 USD
15.10.2018	5.646602	5.613796	TL
15.10.2018	0.943727	0.950814	3,499,661.00 USD
16.10.2018	5.613796	5.541746	TL
16.10.2018	0.950814	0.953616	3,499,661.00 USD
17.10.2018	5.541746	5.493631	TL
17.10.2018	0.953616	0.950554	3,499,661.00 USD
18.10.2018	5.493631	5.430821	TL
18.10.2018	0.950554	0.95571	3,499,661.00 USD
19.10.2018	5.430821	5.290411	TL
19.10.2018	0.95571	0.953262	3,499,661.00 USD
22.10.2018	5.290411	5.337111	TL
22.10.2018	0.953262	0.95078	3,499,661.00 USD
23.10.2018	5.337111	5.375057	TL
23.10.2018	0.95078	0.951658	3,499,661.00 USD
24.10.2018	5.375057	5.464771	TL
24.10.2018	0.951658	0.946937	3,499,661.00 USD
25.10.2018	5.464771	5.429338	TL
25.10.2018	0.946937	0.949683	3,499,661.00 USD
26.10.2018	5.429338	5.41197	TL
26.10.2018	0.949683	0.952862	3,499,661.00 USD
30.10.2018	5.41197	5.358067	TL
30.10.2018	0.952862	0.95363	3,499,661.00 USD
31.10.2018	5.358067	5.266362	TL
31.10.2018	10,482.00	0.95363	3,510,143.00 USD