

YATIRIM FONLARI PORTFÖY DAĞILIM RAPORU

Rapor Dönemi 01/11/2018 ve 30/11/2018

I- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI:	GARANTİ PORTFÖY ÖPY SERBEST ÖZEL 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)	17,102,491.38
E. KATILMA PAYI SAYISI :	13,687,470
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ:	29/09/2017
G. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

II-FONUN PERFORMANS BİLGİLERİ

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI:	1.2495
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	1.197191
C.AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	4.37%
Ç.YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	19.64%
D.YILLIK KATILMA PAYI FİYAT ARTIŞ ORANI:	21.97%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
PAY	21.79%
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ	67.29%
TÜREV TEMİNAT	3.73%
TERS REPO	7.20%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	0.13%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse :	1.33%
Özel Borçlanma Araçları Devir Hızı :	0.20%
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:	922.477
H.KATILMA PAYI İHRÇ. NAKİT GİRİŞLERİ:	2,804,736.57
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			
ARCLK.E	7,000.00	109,480.00	0.65%
ARCLK.E	10,000.00	156,400.00	0.93%
ARCLK.E	5,000.00	78,200.00	0.46%
ASELS.E	5,400.00	144,180.00	0.86%
ASELS.E	7,600.00	202,920.00	1.20%
ASELS.E	5,000.00	133,500.00	0.79%
GARAN.E	30,000.00	248,100.00	1.47%
GARAN.E	25,000.00	206,750.00	1.23%
ISCTR.E	20,000.00	85,200.00	0.51%
ISCTR.E	30,000.00	127,800.00	0.76%
ISCTR.E	15,000.00	63,900.00	0.38%
MGROS.E	15,000.00	234,900.00	1.39%
NTHOL.E	41,000.00	89,380.00	0.53%
NTHOL.E	39,000.00	85,020.00	0.50%
NTHOL.E	120,000.00	261,600.00	1.55%
NTHOL.E	60,000.00	130,800.00	0.78%
NTHOL.E	70,000.00	152,600.00	0.91%
PGSUS.E	10,000.00	253,000.00	1.50%
SODA.E	50,000.00	357,500.00	2.12%
VAKBN.E	30,000.00	120,300.00	0.71%
VAKBN.E	20,000.00	80,200.00	0.48%
YATAS.E	80,000.00	350,400.00	2.08%
Ana Grup Toplamı	695,000.00	3,672,130.00	21.78%
B.BORÇLANMA ARAÇLARI			
B.1.ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI			
TAHVİL			
TRSENSA32314	2,000,000.00	2,379,957.81	14.12%
TRSENSA32314	2,000,000.00	2,379,957.81	14.12%
TRSGZDF51918	400,000.00	393,480.95	2.33%
TRSKCTF71913	2,250,000.00	2,273,903.56	13.49%
TRSRNSHE1916	3,000,000.00	3,123,690.73	18.53%
TRSSRTNE1912	25,000.00	26,506.78	0.16%
TRSTHALE2716	750,000.00	764,290.06	4.53%
Toplam	10,425,000.00	11,341,787.70	67.28%
BONO			
FINANSMAN BONOSU			
GOS(GELİR ORT.SEN)			
GES(GELİRE END.SEN)			
VDMK(VAR DAY MEN K)			
DIŞ BORÇLANMA ARACI			
Ara Grup Toplamı	10,425,000.00	11,341,787.70	67.29%
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			
Ana Grup Toplamı	10,425,000.00	11,341,787.70	67.29%

K.KIRA SERTİFİKALARI			
KIRA SERTİFİKASI			
Ç.TÜREV ARAÇLAR			
TÜREV TEMİNAT			
VIOP-TL	622,904.50	627,904.50	3.73%
Toplam	622,904.50	627,904.50	3.73%
ALIM OPSİYONU			
Ç.1.VIOP OPSİYON			
VIOP ALIM OPSİYONU			
VIOP SATIM OPSİYONU			
Ana Grup Toplamı	622,904.50	627,904.50	3.72%
D.YABANCI SERMAYE PİYASASI ARAÇLARI			
YABANCI TAHVİL			
İKRAZ İŞT. SER			
YABANCI KIRA SER			
YP HİSSE			
BORSA YATIRIM FONLARI			
YP VARANT			
E.ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER			
KIYMETLİ MADEN			
F.VARANTLAR			
G.DİĞER VARLIKLAR			
TERS REPO			
TRT080328T15	1,001,936.44	1,001,936.44	5.94%
TRT150120T16	211,303.49	211,303.49	1.25%
Toplam	1,213,239.93	1,213,239.93	7.19%
REPO			
TAKASBANK BORSA PARA PİYASASI			
MEVDUAT			
YP MEVDUAT			
YATIRIM FONU			
GAYRİMENKUL SERTİFİKASI			
Ana Grup Toplamı	1,213,239.93	1,213,239.93	7.19%
FON PORTFOY DEĞERİ	12,956,144.43	16,855,062.14	

IV- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU			
	Tutarı (TL)	%	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:		16,855,062.14	98.55%
B. HAZİR DEĞERLER (+) :		7,539.40	0.04%
C. ALACAKLAR (+) :		250,200.03	1.46%
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :		0	
E. BORÇLAR (-) :		10,310.19	0.06%
FON TOPLAM DEĞERİ:		17,102,491.38	

V- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	
Açıklama	Tutarı (TL)
370.01.000-Fon Yönetim Ücreti	3,360.69
370.02.000-Denetim Ücreti	813.44
370.03.000-Tahvil Borsa Payı	204.13
370.04.001-Aracılık Kom	1,012.32
370.04.200-Brokerage Komisyonu	149.57
370.05.000-Vergi ve Resim Harç	99.4
370.06.000-Saklama Giderleri	1,245.64
370.20.001-SPK Kayda Alma Mas	356.17
370.23.000-Futures İşlemi Kom	527.47
370.28.000-Portföy Saklama Gideri	1,075.30
370.33.000-Borsa Futures İşlemi Kom	372.81
370.99.000-Diger Giderler	169.63
TOPLAM	9,386.57

[illegible]

Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-01.11.2018	117.875	1	11,787.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-01.11.2018	118.125	1	11,812.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-01.11.2018	118.1	11	129,910.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-01.11.2018	118.125	1	11,812.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-01.11.2018	118.125	22	259,875.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-01.11.2018	118.15	12	141,780.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-01.11.2018	118.125	3	35,437.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-02.11.2018	121.025	41	496,202.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-02.11.2018	121.025	1	12,102.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-02.11.2018	121.025	1	12,102.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-02.11.2018	121.025	1	12,102.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-02.11.2018	121.025	1	12,102.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-02.11.2018	121.025	1	12,102.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-02.11.2018	121.025	1	12,102.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-02.11.2018	121.025	1	12,102.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-02.11.2018	121.025	1	12,102.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-02.11.2018	121.025	1	12,102.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-06.11.2018	5.5258	50	276,290.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-06.11.2018	5.526	1	5,526.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-06.11.2018	5.5266	49	270,803.40 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-06.11.2018	122.8	60	736,800.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-06.11.2018	122.825	20	245,650.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-07.11.2018	5.4922	25	137,305.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-07.11.2018	5.4921	2	10,984.20 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-07.11.2018	5.492	73	400,916.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-07.11.2018	124.125	16	198,600.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-07.11.2018	124.15	34	422,110.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-09.11.2018	119.225	25	298,062.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-12.11.2018	118.65	8	94,920.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-12.11.2018	118.625	7	83,037.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-12.11.2018	118.6	8	94,880.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-12.11.2018	118.575	2	23,715.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-13.11.2018	119.9	30	359,700.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-13.11.2018	120.2	20	240,400.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-20.11.2018	5.4915	200	1,098,300.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-21.11.2018	5.4347	25	135,867.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-21.11.2018	5.4341	12	65,209.20 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-21.11.2018	5.434	63	342,342.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-23.11.2018	118.85	5	59,425.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-23.11.2018	118.825	23	273,297.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-23.11.2018	118.8	22	261,360.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-23.11.2018	118.775	30	356,325.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-26.11.2018	5.3623	100	536,230.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-28.11.2018	120.225	50	601,125.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-29.11.2018	120.95	16	193,520.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-29.11.2018	120.925	34	411,145.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-29.11.2018	121.075	30	363,225.00 Uzun

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	
05.11.2018		2,313,805.00	1.20346	1.212175	13,687,470.00	TL	
06.11.2018			1.212175	1.211839	13,687,470.00	TL	
12.11.2018			1.210119	1.214282	13,687,470.00	TL	
13.11.2018			1.214282	1.217769	13,687,470.00	TL	
19.11.2018			1.22113	1.221404	13,687,470.00	TL	
20.11.2018			1.221404	1.221549	13,687,470.00	TL	
26.11.2018			1.227315	1.23277	13,687,470.00	TL	
27.11.2018			1.23277	1.235924	13,687,470.00	TL	