

YATIRIM FONLARI PORTFÖY DAĞILIM RAPORU

Rapor Dönemi	01/11/2018 ve 30/11/2018
I- FONU TANITICI BİLGİLER	
A. FONUN ADI:	GARANTİ PORTFÖY MUTLAK GETİRİ HEDEFLİ DEĞİŞKEN 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)	19,328,814.20
E. KATILMA PAYI SAYISI :	17,019,715
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ:	02.12.2018
G. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

II-FONUN PERFORMANS BİLGİLERİ	TL
A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI:	1.135672
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	1.103852
C.AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	2.88%
Ç.YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	
D.YILLIK KATILMA PAYI FİYAT ARTIŞ ORANI:	
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
PAY	31.95%
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ	23.96%
ÖZEL SEKTÖR FINANSMAN BONOSU	1.90%
TÜREV TEMİNAT	5.21%
YABANCI HİSSE SENETLERİ	3.99%
TERS REPO	4.83%
TAKASBANK BORSA PARA PİYASASI	28.17%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	0.17%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse :	1.03%
Özel Borçlanma Araçları Devir Hızı :	0.53%
Kamu Borçlanma Araçları Devir Hızı :	0.00%
Kira Sertifikaları Devir Hızı :	0.00%
Yabancı Menkul Kıymetler Devir Hızı :	0.01%
Altın Devir Hızı :	0.00%
Varant Devir Hızı :	0.00%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	591.055
H.KATILMA PAYI İHRÇ. NAKİT GİRİŞLERİ:	2,080,413.81
I.KATILMA PAYI İADE. NAKİT ÇIKIŞLARI:	1,897,145.46
J. AYLIK KORELASYON:	
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON:	

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nom.Değ(TL)	Rayiç.Değ(TL)	%
A.PAY			
AKBNK.E	45,000.00	344,700.00	1.77%
AKBNK.E	20,000.00	153,200.00	0.79%
ARCLK.E	10,000.00	156,400.00	0.80%
ARCLK.E	5,000.00	78,200.00	0.40%
ASELS.E	12,000.00	320,400.00	1.65%
ASELS.E	5,000.00	133,500.00	0.69%
BIMAS.E	2,500.00	211,250.00	1.09%
BIMAS.E	2,500.00	211,250.00	1.09%
EREGL.E	25,000.00	189,750.00	0.98%
EREGL.E	10,000.00	75,900.00	0.39%
GARAN.E	2,000.00	16,540.00	0.09%
GARAN.E	10,000.00	82,700.00	0.43%
GARAN.E	63,000.00	521,010.00	2.68%
GARAN.E	35,000.00	289,450.00	1.49%
ISCTR.E	4,000.00	17,040.00	0.09%
ISCTR.E	16,000.00	68,160.00	0.35%
ISCTR.E	10,000.00	42,600.00	0.22%
ISCTR.E	10,000.00	42,600.00	0.22%
KOZAL.E	2,000.00	105,100.00	0.54%
KOZAL.E	1,000.00	52,550.00	0.27%
KRDMD.E	20,000.00	50,600.00	0.26%
KRDMD.E	10,000.00	25,300.00	0.13%
MAVIE	500	18,850.00	0.10%
MAVIE	2,000.00	75,400.00	0.39%
MAVIE	1,500.00	56,550.00	0.29%
MGROS.E	15,000.00	234,900.00	1.21%
NTHOL.E	15,000.00	32,700.00	0.17%
NTHOL.E	5,000.00	10,900.00	0.06%
NTHOL.E	70,000.00	152,600.00	0.78%
NTHOL.E	60,000.00	130,800.00	0.67%
PGSUS.E	4,000.00	101,200.00	0.52%
PGSUS.E	4,000.00	101,200.00	0.52%
SAHOL.E	30,000.00	246,900.00	1.27%
SAHOL.E	10,000.00	82,300.00	0.42%
SODA.E	12,000.00	85,800.00	0.44%
SODA.E	8,000.00	57,200.00	0.29%
TCELL.E	10,000.00	126,900.00	0.65%
TCELL.E	15,000.00	190,350.00	0.98%
THYAO.E	4,000.00	68,000.00	0.35%
THYAO.E	3,000.00	51,000.00	0.26%
THYAO.E	8,000.00	136,000.00	0.70%
TKFEN.E	1,000.00	20,040.00	0.10%
TKFEN.E	4,000.00	80,160.00	0.41%
TKFEN.E	2,000.00	40,080.00	0.21%
TRKCM.E	0.81	2.53	
TTKOM.E	25,000.00	97,750.00	0.50%
TTKOM.E	10,000.00	39,100.00	0.20%
TUPRS.E	1,500.00	187,350.00	0.96%
TUPRS.E	1,500.00	187,350.00	0.96%
VAKBN.E	40,000.00	160,400.00	0.83%
VAKBN.E	10,000.00	40,100.00	0.21%
VAKBN.E	20,000.00	80,200.00	0.41%
YATAS.E	20,000.00	87,600.00	0.45%
YATAS.E	10,000.00	43,800.00	0.23%
YKBNK.E	0.83	1.44	
Ana Grup Toplamı	742,001.64	6,211,683.97	31.94%

B.BORÇLANMA ARAÇLARI

B.1.ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI

TAHVİL			
TRSATAYE1918	1,000,000.00	1,034,904.40	5.32%
TRSENSA32314	300,000.00	356,993.67	1.84%
TRSENSA32314	700,000.00	832,985.24	4.28%
TRSENSA32314	300,000.00	356,993.67	1.84%
TRSGZDF31910	1,000,000.00	1,026,685.46	5.28%
TRISGY32111	180,000.00	188,868.50	0.97%
TRSKCTF32014	350,000.00	328,190.34	1.69%
TRSOPAS22012	150,000.00	155,857.08	0.80%
TRSOPAS42010	370,000.00	376,153.27	1.93%
Toplam	4,350,000.00	4,657,631.63	23.95%

BONO			
FINANSMAN BONOSU			
TRFISFN41916	400,000.00	369,029.16	1.90%
Toplam	400,000.00	369,029.16	1.90%

GOS(GELİR ORT.SEN)			
GES(GELİRE END.SEN)			
VDMK(VAR DAY MEN K)			
DIŞ BORÇLANMA ARACI			
Ara Grup Toplamı	4,750,000.00	5,026,660.79	25.85%

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			
Ara Grup Toplamı	4,750,000.00	5,026,660.79	25.85%

C.KİRA SERTİFİKALARI			
KİRA SERTİFİKASI			
Ç.TÜREV ARAÇLAR			
TÜREV TEMİNAT			
VIOP-TL	1,007,080.15	1,011,985.15	5.21%
Toplam	1,007,080.15	1,011,985.15	5.21%
ALIM OPSİYONU			
Ç.1.VIOP OPSİYON			
VIOP ALIM OPSİYONU			
VIOP SATIM OPSİYONU			
Ara Grup Toplamı	1,007,080.15	1,011,985.15	5.20%

D.YABANCI SERMAYE PİYASASI ARAÇLARI

YABANCI TAHVİL			
İKRAZ İŞT. SER			
YABANCI KİRA SER			
YP HİSSE			
BORSA YATIRIM FONLARI			
CBU7LN	60	38,089.60	0.20%
CSPXLN	38	52,369.95	0.27%
CSPXLN	4	5,512.63	0.03%
CSPXLN	2	2,756.31	0.01%
CSUSSW	13	17,407.20	0.09%
EIMILN	59	8,021.89	0.04%
EMCRLN	3	1,491.09	0.01%
EMCRLN	67	33,301.12	0.17%
EMUUSW	1,009.00	28,884.15	0.15%
EMUUSW	82	2,347.37	0.01%
EMUUSW	205	5,868.43	0.03%
IDBTLN	59	39,645.47	0.20%
IDBTLN	4	2,687.83	0.01%
IDTLLN	1,107.00	24,861.82	0.13%
IDTLLN	2,144.00	48,151.53	0.25%
IDTLLN	261	5,861.73	0.03%
IDTMLN	16	15,401.69	0.08%
IDTMLN	49	47,167.68	0.24%
IDTPLN	14	14,526.24	0.07%
IEMBSW	28	14,783.26	0.08%
IGLNLN	129	15,934.47	0.08%
IHYULN	31	15,786.87	0.08%
IHYULN	44	22,407.17	0.12%
IJPALN	69	14,361.42	0.07%
IMBSLN	5,504.00	134,251.25	0.69%
IWDPSW	118	15,371.37	0.08%
LQDHLN	204	100,279.31	0.52%
LQDHLN	14	6,881.91	0.04%
LQDHLN	5	2,457.83	0.01%
LQDHLN	28	13,763.83	0.07%
SPMVLN	84	22,562.60	0.12%
SPMVLN	10	2,686.02	0.01%
Toplam	11,464.00	775,881.04	3.99%
YP VARANT			
Ara Grup Toplamı	11,464.00	775,881.04	3.99%

E.ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER

KIYMETLİ MADEN			
F.VARANTLAR			
G.DİĞER VARLIKLAR			
TERS REPO			
TRT010420T19	270,388.36	270,388.36	1.39%
TRT150120T16	500,968.63	500,968.63	2.58%
TRT150120T16	167,240.21	167,240.21	0.86%
Toplam	938,597.20	938,597.20	4.83%

REPO			
TAKASBANK BORSA PARA PİYASASI			
TBPP	3,294,246.58	3,292,100.25	16.93%
TBPP	1,099,673.97	1,094,640.58	5.63%
TBPP	1,101,024.66	1,090,799.58	5.61%
Toplam	5,494,945.21	5,477,540.41	28.17%

MEVDUAT			
YP MEVDUAT			
YATIRIM FONU			
GAYRİMENKUL SERTİFİKASI			
Ara Grup Toplamı	6,433,542.41	6,416,137.61	33.00%

FON PORTFOY DEĞERİ12,944,088.2019,442,348.56

IV- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

	Tutarı (TL)	%	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:			
B. HAZİR DEĞERLER (+) :	19,442,348.56	100.59%	
C. ALACAKLAR (+) :	9,324.84	0.05%	
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	239,639.97	1.24%	
E. BORÇLAR (-) :	0		
	362,499.17	1.88%	

FON TOPLAM DEĞERİ:19,328,814.20

V- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı (TL)
370.01.000-Fon Yönetim Ücreti	35,282.24
370.02.000-Denetim Ücreti	813.44
370.03.000-Tahvil Borsa Payı	208.01
370.04.001-Aracılık Kom	1,214.60
370.04.200-Brokerage Komisyonu	130.35
370.05.000-Vergi ve Resim Harç	99.4
370.06.000-Saklama Giderleri	1,756.98
370.20.001-SPK Kayda Alma Mas	348.58
370.23.000-Futures İşlemi Kom	638.53
370.28.000-Portföy Saklama Gideri	1,227.50
370.33.000-Borsa Futures İşlemi Kom	461.09
370.99.000-Diger Giderler	169.63

TOPLAM42,350.35

VI- GEÇEN AY İÇİNDE

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

Açıklama	Nominal (TL)
BIMAS Tem:% 80	

VII- PORTFÖYDEN SATIŞLAR

Sermaye Piyasası Aracıİhraççı KurumSatış TarihiNominal (TL)Satış Değ. (TL)

VIII- İTFALAR

Sermaye Piyasası Aracı	İtfa Tarihi	Nominal (TL)
TRFDSTFK1824	09.11.18	500,000.00
TRFTPFCK1810	19.11.18	500,000.00

IX- PORTFÖYE ALIŞLAR

Sermaye Piyasası Aracıİhraççı KurumAlış Tarihi-G.D.TarihiNominal (TL)Alış Değ. (TL)

X- ÖDÜNC İŞLEMLERİ

Sermaye Piyasası AracıMenkul Kıymetİşlem-Vade TarihiNominalCari 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_XU0301218-GRM	VIOP-01.11.2018	117.9	50	589,500.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-02.11.2018	121.25	13	157,625.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-02.11.2018	121.225	17	206,082.50	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-02.11.2018	121	10	121,000.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-06.11.2018	5.5396	100	553,960.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-06.11.2018	122.6	20	245,200.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-07.11.2018	5.5145	71	391,529.50	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-07.11.2018	5.5144	10	55,144.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-07.11.2018	5.5137	19	104,760.30	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-07.11.2018	123.15	30	369,450.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-08.11.2018	123.85	40	495,400.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-08.11.2018	122.55	40	490,200.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-09.11.2018	119.15	9	107,235.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-09.11.2018	119.125	31	369,287.50	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-12.11.2018	118.5	20	237,000.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-13.11.2018	119.75	30	359,250.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-13.11.2018	120.2	30	360,600.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-19.11.2018	121.075	14	169,505.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-19.11.2018	121.05	50	605,250.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-19.11.2018	121.075	11	133,182.50	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-19.11.2018	121.1	50	605,500.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-19.11.2018	121.125	35	423,937.50	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-20.11.2018	5.4904	10	54,904.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-20.11.2018	5.4905	35	192,167.50	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-20.11.2018	5.4908	105	576,534.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-21.11.2018	5.4336	10	54,336.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-21.11.2018	5.4335	25	135,837.50	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-21.11.2018	5.433	15	81,495.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-21.11.2018	118.45	10	118,450.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-21.11.2018	118.475	20	236,950.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-23.11.2018	118.85	31	368,435.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-23.11.2018	118.825	49	582,242.50	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-26.11.2018	5.3621	4	21,448.40	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-26.11.2018	5.3619	46	246,647.40	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-26.11.2018	5.3631	50	268,155.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-27.11.2018	5.3196	25	132,990.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1218-GRM	VIOP-27.11.2018	5.3185	25	132,962.50	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-28.11.2018	120.125	71	852,887.50	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-28.11.2018	120.15	9	108,135.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301218-GRM	VIOP-29.11.2018	120.975	80	967,800.00	Kısa

XII- PAY ALIM SATIM DEFTERİ

Toplam Pay Adedi10,000,000,000.00

Tarih	Pay Alışı	Pay Satışı	Alış Fiyatı	Satış Fiyatı	Dolaşımdaki Pay	Pay Döviz Kodu
01.11.2018		299,927.00	54,354.00	1.103749	16,897,711.00	TL
02.11.2018			33	1.103852	16,825,814.00	TL
05.11.2018		71,930.00	107,758.00	1.108535	16,933,572.00	TL

06.11.2018		4,485.00	1.113591	1.114746	16,459,170.00 TL
07.11.2018	478,887.00	8,756.00	1.114746	1.113045	16,367,992.00 TL
08.11.2018	99,934.00	49,654.00	1.113045	1.115139	16,346,085.00 TL
09.11.2018	71,561.00	47	1.115139	1.114193	16,346,132.00 TL
12.11.2018		5,821.00	1.114193	1.116259	16,351,953.00 TL
13.11.2018		153,819.00	1.116259	1.117405	16,391,793.00 TL
14.11.2018	113,979.00	45,265.00	1.117405	1.117809	16,340,886.00 TL
15.11.2018	96,172.00	141,152.00	1.117809	1.118156	16,433,399.00 TL
16.11.2018	48,639.00	22,372.00	1.118156	1.12039	16,455,743.00 TL
19.11.2018	28	148,066.00	1.12039	1.121439	16,592,314.00 TL
20.11.2018	11,495.00	193,864.00	1.121439	1.122842	16,786,042.00 TL
21.11.2018	136	31,232.00	1.122842	1.120605	16,816,806.00 TL
22.11.2018	468	38,295.00	1.120605	1.122821	16,850,560.00 TL
23.11.2018	4,541.00	80,003.00	1.122821	1.121983	16,742,621.00 TL
26.11.2018	187,942.00	333,489.00	1.121983	1.124472	16,867,093.00 TL
27.11.2018	209,017.00	53,227.00	1.124472	1.127233	16,915,821.00 TL
28.11.2018	4,499.00	154,504.00	1.127233	1.128254	17,068,056.00 TL
29.11.2018	2,269.00	227,616.00	1.128254	1.12951	17,295,658.00 TL
30.11.2018	14	393	1.12951	1.132268	17,019,715.00 TL