

ZPE-KATILIMENDKSİ HS
ARALIK - 2018 AYLİK RAPORU

1 - FONU TANITICI BİLGİLER

A - FONUN ADI	: ZPE-ZPY KATILIM ENDEKSİ HİSSE SENEDİ FON (HSYF)
B - KURUCUNUN ÜNVANI	: ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C - YÖNETİCİNİN ÜNVANI	: ZİRAAT PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D - FON TUTARI	: 3.000.000.000,00
E - FON TOPLAM DEĞERİ	: 3.840.792,06
F - TEDAVÜLDEKİ PAY SAYISI	: 3.339.071,000
G - FONUN KURULUŞ TARİHİ	: 31.08.2015
H - FONUN SÜRESİ	: SÜRESİZ
I - AYLIK KORELASYON KATSAYISI	: 0,9929
İ - ÜÇ AYLIK KORELASYON KATSAYISI	: 0,9946

2 - FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A - AY SONU PAY FİYATI	: 1,140053
B - ÖNCEKİ AY PAY FİYATI	: 1,211954
C - AYLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI	: -5,932651
D - YIL BAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	: -14,575769
E - YILLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI	: -14,575769
F - AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	
İMKB'de İşlem Gören Hisse Senetleri	: 92,401115
Satış Vaadiyle Alış	: -1,596830
Katılım Hesabı	: 3,974772
Kira Sertifikası Kıymetler	: 2,027283
Diğer	: 3,193660
G - AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 0,001157
H - AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	: 5,418613
I - PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 25,687877

3 - FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

A - HİSSE SENETLERİ	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
1. Banka İştirak ve Hissedarları			
2. Diğer Ortaklıklar			
1 AKGUV.E	2.865,631	5.759,92	0,151815
2 ALBRK.E	14.243,000	17.376,46	0,457993
3 EREGL.E	32.126,000	231.949,72	6,113520
4 MPARK.E	12.030,000	128.721,00	3,392711
5 ADANA.E	8.031,000	48.587,55	1,280627
6 ALKIM.E	3.355,000	79.513,50	2,095745
7 DGATE.E	1.734,000	7.421,52	0,195610
8 HEKTS.E	1.200,000	11.124,00	0,293196
9 HLGYO.E	20.055,000	14.038,50	0,370014
10 KNFRT.E	1.749,000	41.766,12	1,100833
11 MAVI.E	6.245,000	201.213,90	5,303413
12 PNSUT.E	2.461,000	16.291,82	0,429405
13 ULUSE.E	9.214,000	147.055,44	3,875954
14 ALCTL.E	2.091,000	12.044,16	0,317449
15 EKGYO.E	100.000,000	150.000,00	3,953564
16 OTKAR.E	1.070,000	94.427,50	2,488834
17 EGSR.E	3.131,000	10.488,85	0,276456
18 ALKA.E	4.725,000	19.608,75	0,516830
19 AYGAZ.E	11.184,000	126.714,72	3,339832
20 CEMTS.E	7.413,000	45.071,04	1,187942
21 EGEEN.E	244,000	83.936,00	2,212309
22 GOODY.E	11.232,000	38.638,08	1,018387
23 LOGO.E	2.343,000	63.589,02	1,676022
24 AKCNS.E	5.801,000	42.637,35	1,123797
25 BANVT.E	1.173,000	12.656,67	0,333593
26 BIMAS.E	6.329,000	550.623,00	14,512821
27 FROTO.E	7.675,000	383.750,00	10,114534
28 ISDMR.E	22.146,000	125.346,36	3,303766
29 KONYA.E	108,000	19.224,00	0,506689
30 MRDIN.E	6.977,000	22.745,02	0,599493
31 TATGD.E	8.231,000	31.442,42	0,828731
32 PETUN.E	1.790,000	9.164,80	0,241557
33 SELEC.E	20.661,000	57.644,19	1,519333
34 ANELE.E	20.000,000	32.400,00	0,853970

35 ASEL.S.E	18.920,000	455.593,60	12,008122
36 CUSAN.E	2.891,000	5.145,98	0,135633
37 KARTN.E	154,000	50.250,20	1,324449
38 ORGE.E	4.786,000	14.932,32	0,393573
39 YATAS.E	16.750,000	74.872,50	1,973421
B - DEVLET TAHVİLİ ve HAZİNE BONOLARI	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
C - TERS REPO	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
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 (%)
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 ENDEKSİLİ 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 (%)
O - KİRA SERTİFİKASI KIYMETLER	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
13.02.2019 TRD130219T18	80.000	82.740,96	2,180811
P - EUROBOND	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
R - VADELİ MEVDUAT	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
S - KATILIM HESABI	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
03.01.2019 3AyaKadarVD-ZTB-TRY	32.681	32.641,00	0,860322
09.01.2019 3AyaKadarVD-ZTB-TRY	65.338	65.008,87	1,713445
09.01.2019 3AyaKadarVD-ZTB-TRY	65.176	64.847,53	1,709192
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 (%)
Z - Satış Vaadiyle Alış	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
1 02.01.2019	65.082	65.040,95	1,714290
AA - Alış Vaadiyle Satış	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)

4 - FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

	Tutar	Oran (%)
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	3.794.045,27	98,782887
B. HAZIR DEĞERLER	6.317,15	0,164475
b) Bankalar	6.317,15	0,164475
c) Hazır Değerler	0,00	0,000000
a) Takastan Alacaklar T1	0,00	0,000000
b) Takastan Alacaklar T2	185.173,36	4,821228
d) Temettü Alacakları	33,60	0,000875
e) Diğer Alacaklar	0,00	0,000000
D. DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,000000
b) Geçmiş Yıl Peşin Ödenmiş Vergiler	0,00	0,000000
E. BORÇLAR	144.777,32	3,769465
a) Takasa Borçlar T1	0,00	0,000000
c) Takasa Borçlar	0,00	0,000000
d) Yönetim Ücreti	5.879,53	0,153081
e) Vergi Yasal Yükümlülükler Karşılığı	0,00	0,000000
g) İhtiyatlar	0,00	0,000000
h) Krediler	0,00	0,000000
i) Pay Geri Alışından Borçlar	136.838,28	3,562762
k) Diğer Borçlar	1.867,47	0,048622
FON TOPLAM DEĞERİ	3.840.792,06	100,000000
Toplam Pay Sayısı	6.000.000.000,00	
FİYAT	1,150258	
f) Takastan Alacaklar(Metal-Altın)	0,00	0,000000
l) Takasa Borçlar(Metal Altın)	0,00	0,000000
g) Diğer Alacaklar(Opsiyon)	0,00	0,000000
a) Kasa	0,00	0,000000
C. ALACAKLAR	185.206,96	4,822103
c) Takastan Alacaklar	0,00	0,000000
a) Cari Yıl Peşin Ödenmiş Vergiler	0,00	0,000000
b) Takasa Borçlar T2	0,00	0,000000
f) Ödenecek Vergi Resim Harçlar	0,00	0,000000
j) SPK Kayda Alma Ücreti	192,04	0,005000
Dolaşımdaki Pay Sayısı	3.339.071,000	
h) Takasbank Dışı İşlemlerden Alacaklar	0,00	0,000000
m) Takasbank Dışı İşlemlerden Borçlar	0,00	0,000000
n) Borsa Kotundan Çıkarılan ÖST/ÖSB için Ayrılan Karşılık	0,00	0,000000

5 - AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

1 ihrac izni Ücretleri	52,99
2 ilan Giderleri	0,00
3 Sigorta Ücretleri	0,00
4 Aracılık Komisyon Giderleri	34,62
4 Döviz aracılık komisyonları	0,00
5 Noter Harç ve Tasdik Ücretleri	0,00
6 Fon Yönetim Ücretleri	196,95
7 Vergi, Resim, Harç vb. Giderler	38,80
8 Metal Saklama Giderleri	0,00
8 Saklama Giderleri	63,63
9 Portföy Yönetim Ücreti	5.682,58
10 IMKB Endeksleri Lisans Ücreti	0,00
11 EFT Masrafı	9,66
12 Türev İşlemler Aracılık Komisyonu	0,00

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

Tarih	Kıymet Kodu	Nominal	Tutar	Oran Açıklama
17.12.2018	ASELS.E	18.920,000	468,02	0,024737 Temettü ödemesi

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

8 - PORTFÖYDEN SATIŞLAR

Türü	Vade Tarihi	Tanımlı	Satış Tarihi	Nominal Değeri	Satış Değeri
HS		EKGY0.E	28.12.2018	25,000	37,75
HS		EKGY0.E	28.12.2018	48.000,000	72.480,00
HS		HEKTS.E	31.12.2018	100,000	935,00
HS		HEKTS.E	31.12.2018	1.000,000	9.350,00
HS		HEKTS.E	31.12.2018	100,000	934,00
HS		HEKTS.E	31.12.2018	350,000	3.265,50
HS		HEKTS.E	31.12.2018	500,000	4.665,00
HS		HEKTS.E	31.12.2018	1.000,000	9.330,00
HS		HEKTS.E	31.12.2018	250,000	2.330,00
HS		HEKTS.E	31.12.2018	1.350,000	12.582,00
HS		HEKTS.E	31.12.2018	10,000	93,20
HS		HEKTS.E	31.12.2018	25,000	233,00
HS		HEKTS.E	31.12.2018	1,000	9,32
HS		HEKTS.E	31.12.2018	100,000	932,00
HS		HEKTS.E	31.12.2018	169,000	1.575,08
HS		HEKTS.E	26.12.2018	1,000	9,20
HS		HEKTS.E	26.12.2018	762,000	7.010,40
HS		HEKTS.E	26.12.2018	1.502,000	13.818,40
HS		HEKTS.E	26.12.2018	120,000	1.104,00
HS		HEKTS.E	26.12.2018	378,000	3.477,60
HS		HEKTS.E	25.12.2018	594,000	5.446,98
HS		HEKTS.E	25.12.2018	300,000	2.751,00
HS		HEKTS.E	25.12.2018	106,000	972,02
HS		ANELE.E	31.12.2018	7.463,000	11.866,17
HS		VESBE.E	28.12.2018	92,000	1.075,48
HS		VESBE.E	28.12.2018	500,000	5.845,00
HS		VESBE.E	28.12.2018	253,000	2.957,57
HS		VESBE.E	28.12.2018	398,000	4.652,62
HS		VESBE.E	28.12.2018	3,000	35,07
HS		VESBE.E	28.12.2018	10,000	116,90
HS		VESBE.E	28.12.2018	10,000	116,90
HS		VESBE.E	28.12.2018	10,000	116,90
HS		VESBE.E	28.12.2018	22,000	257,18
HS		VESBE.E	28.12.2018	20,000	233,80
HS		VESBE.E	28.12.2018	25,000	292,25
HS		VESBE.E	28.12.2018	1,000	11,69
HS		VESBE.E	28.12.2018	7,000	81,83
HS		VESBE.E	28.12.2018	40,000	467,60
HS		VESBE.E	28.12.2018	20,000	233,80
HS		VESBE.E	28.12.2018	24,000	280,56
HS		VESBE.E	28.12.2018	11,000	128,59

HS	VESBE.E	28.12.2018	725,000	8.475,25
HS	VESBE.E	28.12.2018	15,000	175,50
HS	ERBOS.E	28.12.2018	209,000	12.916,20
HS	ERBOS.E	28.12.2018	16,000	988,80
HS	ERBOS.E	28.12.2018	55,000	3.399,00
HS	ERBOS.E	28.12.2018	101,000	6.246,85
HS	ERBOS.E	28.12.2018	10,000	619,00
HS	ERBOS.E	28.12.2018	22,000	1.361,80
HS	ERBOS.E	28.12.2018	56,000	3.469,20

9 - İTFA

Türü	Vade Tarihi	Tanımlı	İtfa Tarihi	Nominal Değeri	İtfa Değeri
------	-------------	---------	-------------	----------------	-------------

10 - PORTFÖYE ALIŞLAR

Türü	Vade Tarihi	Tanımlı	Alış Tarihi	Nominal Değeri	Alış Değeri
KTAL	09.01.2019	3AyaKadarVD-ZTB-TRY	06.12.2018	0,000	63.779,87
KTAL	09.01.2019	3AyaKadarVD-ZTB-TRY	05.12.2018	0,000	63.898,09
SVDA	02.01.2019	TRD070623T16	31.12.2018	52.981,000	65.000,00
SVDA	31.12.2018	TRD070623T16	28.12.2018	65.425,000	80.000,00
SVDA	28.12.2018	TRD070623T16	27.12.2018	40.876,000	50.000,00
SVDA	27.12.2018	TRD070623T16	26.12.2018	36.822,000	45.000,00
SVDA	26.12.2018	TRD070623T16	25.12.2018	36.855,000	45.000,00
SVDA	25.12.2018	TRD070623T16	24.12.2018	45.086,000	55.000,00
SVDA	24.12.2018	TRD070623T16	21.12.2018	45.266,000	55.000,00
SVDA	21.12.2018	TRD070623T16	20.12.2018	45.250,000	55.000,00
SVDA	20.12.2018	TRD121022T14	19.12.2018	41.747,000	55.000,00
SVDA	19.12.2018	TRD121022T14	18.12.2018	30.389,000	40.000,00
SVDA	18.12.2018	TRD121022T14	17.12.2018	41.822,000	55.000,00
SVDA	17.12.2018	TRD121022T14	14.12.2018	38.172,000	50.000,00
SVDA	14.12.2018	TRD121022T14	13.12.2018	45.790,000	60.000,00
SVDA	13.12.2018	TRD121022T14	12.12.2018	45.831,000	60.000,00
SVDA	12.12.2018	TRD121022T14	11.12.2018	57.341,000	75.000,00
SVDA	11.12.2018	TRD121022T14	10.12.2018	61.219,000	80.000,00
SVDA	10.12.2018	TRD121022T14	07.12.2018	61.464,000	80.000,00
SVDA	07.12.2018	TRD121022T14	06.12.2018	38.402,000	50.000,00
SVDA	06.12.2018	TRD121022T14	05.12.2018	57.655,000	75.000,00
SVDA	05.12.2018	TRD121022T14	04.12.2018	84.638,000	110.000,00
SVDA	04.12.2018	TRD121022T14	03.12.2018	96.268,000	125.000,00