

YATIRIM FONLARI PORTFÖY DAĞILIM RAPORU

Rapor Dönemi 01/01/2019 ve 31/01/2019

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) 20,480,760.53
E. KATILMA PAYI SAYISI : 16,172,758
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ: 29/09/2017
G. FONUN SÜRESİ: SÜRESİZ

II-FONUN PERFORMANS BİLGİLERİ

TL
A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI: 1.266374
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI: 1.254503
C.AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI: 0.95%
Ç.YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI: 0.95%
D.YILLIK KATILMA PAYI FİYAT ARTIŞ ORANI: 19.26%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:
PAY 16.19%
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ 56.97%
TÜREV TEMİNAT 3.03%
TERS REPO 1.43%
TAKASBANK BORSA PARA PİYASASI 22.38%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI: 0.14%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:
Hisse : 0.56%
Özel Borçlanma Araçları Devir Hızı : 0.03%
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: 924.466
H.KATILMA PAYI İHRÇ. NAKİT GİRİŞLERİ: 5,644,619.95
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	10,000.00	185,200.00	0.91%
ARCLK.E	5,000.00	92,600.00	0.46%
EREGL.E	25,000.00	212,250.00	1.05%
EREGL.E	25,000.00	212,250.00	1.05%
GARAN.E	40,000.00	362,400.00	1.78%
GARAN.E	20,000.00	181,200.00	0.89%
ISCTR.E	40,000.00	227,200.00	1.12%
KOZAL.E	3,000.00	160,950.00	0.79%
MGROS.E	12,500.00	212,500.00	1.05%
NTHOL.E	70,000.00	129,500.00	0.64%
NTHOL.E	60,000.00	111,000.00	0.55%
NTHOL.E	70,000.00	129,500.00	0.64%
PGSUS.E	10,000.00	303,200.00	1.49%
TCELL.E	10,000.00	145,100.00	0.71%
THYAO.E	15,000.00	231,300.00	1.14%
VAKBN.E	25,000.00	119,500.00	0.59%
YATAS.E	55,000.00	271,700.00	1.34%
Ana Grup Toplamı	495,500.00	3,287,350.00	16.19%
B.BORÇLANMA ARAÇLARI			
B.1.ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI			
TAHVİL			
TRSENSA32314	2,000,000.00	2,369,848.02	11.67%
TRSENSA32314	2,000,000.00	2,369,848.02	11.67%
TRSGZDF51918	400,000.00	415,313.60	2.05%
TRSKCTF32014	400,000.00	396,594.89	1.95%
TRSKCTF71913	2,250,000.00	2,187,089.65	10.77%
TRSRNSHE1916	3,000,000.00	3,042,669.78	14.99%
TRSSRTNE1912	25,000.00	25,241.76	0.12%
TRSTHALE2716	750,000.00	759,301.80	3.74%
Toplam	10,825,000.00	11,565,907.52	56.96%
BONO			
FINANSMAN BONOSU			
GOS(GELİR ORT.SEN)			
GES(GELİRE END.SEN)			
VDMK(VAR DAY MEN K)			
DIŞ BORÇLANMA ARACI			
Ara Grup Toplamı	10,825,000.00	11,565,907.52	56.96%
Ara Grup Toplamı	10,825,000.00	11,565,907.52	56.96%
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	10,825,000.00	11,565,907.52	56.96%
C.KIRA SERTİFİKALARI			
KIRA SERTİFİKASI			

Ç.TÜREV ARAÇLAR							
TÜREV TEMİNAT							
VIOP-TL	617,577.62	615,533.62	3.03%				
Toplam	617,577.62	615,533.62	3.03%				
ALIM OPSİYONU							
Ç.1.VIOP OPSİYON							
VIOP ALIM OPSİYONU							
VIOP SATIM OPSİYONU							
Ana Grup Toplamı	617,577.62	615,533.62	3.03%				
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							
TRT010420T19	291,147.49	291,147.49	1.43%				
Toplam	291,147.49	291,147.49	1.43%				
REPO							
TAKASBANK BORSA PARA PİYASASI							
TBPP	4,604,424.66	4,543,426.00	22.38%				
Toplam	4,604,424.66	4,543,426.00	22.38%				
MEVDUAT							
YP MEVDUAT							
YATIRIM FONU							
GAYRİMENKUL SERTİFİKASI							
Ana Grup Toplamı	4,895,572.15	4,834,573.49	23.81%				
FON PORTFOY DEĞERİ	16,833,649.77	20,303,364.63					
IV- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU							
	Tutarı (TL)	%					
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	20,303,364.63	99.13%					
B. HAZİR DEĞERLER (+) :	6,688.40	0.03%					
C. ALACAKLAR (+) :	182,750.00	0.89%					
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0						
E. BORÇLAR (-) :	12,042.50	0.06%					
FON TOPLAM DEĞERİ:	20,480,760.53						
V- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER							
Açıklama	Tutarı (TL)						
370.01.000-Fon Yönetim Ücreti	3,811.34						
370.03.000-Tahvil Borsa Payı	169.67						
370.04.000-Aracılık Komisyonu	361.81						
370.04.200-Brokerage Komisyonu	98.46						
370.05.000-Vergi ve Resim Harç	48						
370.06.000-Saklama Giderleri	797.2						
370.15.001-BPP Kom	413.44						
370.20.001-SPK Kayda Alma Mas	352.88						
370.23.000-Futures İşlemi Kom	811.88						
370.27.000-BPP İşlem Masrafı	1,044.25						
370.28.000-Portföy Saklama Gideri	1,219.51						
370.33.000-Borsa Futures İşlemi Kom	542.16						
370.99.000-Diger Giderler	1,939.24						
TOPLAM	11,609.84						
VI- GEÇEN AY İÇİNDE							
RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI							
BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM							
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	İtfa 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_USDTRY0219-GRM	VIOP-02.01.2019	5.5432	25	138,580.00	Uzun	
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-02.01.2019	5.5439	75	415,792.50	Uzun	
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-02.01.2019	5.5441	4	22,176.40	Uzun	
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-02.01.2019	5.5449	4	22,179.60	Uzun	
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-02.01.2019	5.545	3	16,635.00	Uzun	
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-02.01.2019	5.5454	39	216,270.60	Uzun	
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-03.01.2019	5.6352	6	33,811.20	Uzun	
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-03.01.2019	5.6369	144	811,713.60	Uzun	
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-03.01.2019	114.2	25	285,500.00	Kısa	
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-03.01.2019	113.625	80	909,000.00	Kısa	

Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-04.01.2019	5.5602	25	139,005.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-04.01.2019	5.5601	2	11,120.20 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-04.01.2019	5.56	73	405,880.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-04.01.2019	5.5606	5	27,803.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-04.01.2019	5.56	95	528,200.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-07.01.2019	115.75	19	219,925.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-07.01.2019	115.925	6	69,555.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-08.01.2019	5.551	25	138,775.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-08.01.2019	5.5518	20	111,036.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-08.01.2019	5.5519	9	49,967.10 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-08.01.2019	5.552	46	255,392.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-09.01.2019	5.6307	14	78,829.80 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-09.01.2019	5.6308	36	202,708.80 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-10.01.2019	5.5855	1	5,585.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-10.01.2019	5.5851	1	5,585.10 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-10.01.2019	5.5847	48	268,065.60 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-14.01.2019	117.4	25	293,500.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-14.01.2019	118	30	354,000.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-16.01.2019	5.5067	25	137,667.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-16.01.2019	5.5066	5	27,533.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-16.01.2019	5.5062	24	132,148.80 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-16.01.2019	5.5061	46	253,280.60 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-16.01.2019	5.4911	10	54,911.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-16.01.2019	5.491	40	219,640.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-17.01.2019	5.4816	1	5,481.60 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-17.01.2019	5.4815	1	5,481.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-17.01.2019	5.4812	33	180,879.60 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-17.01.2019	5.4811	15	82,216.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-18.01.2019	126.8	10	126,800.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-21.01.2019	127.2	4	50,880.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-21.01.2019	127.175	26	330,655.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-23.01.2019	129.775	40	519,100.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-24.01.2019	131.175	20	262,350.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-28.01.2019	5.366	4	21,464.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-28.01.2019	5.3663	1	5,366.30 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-28.01.2019	5.3669	45	241,510.50 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-28.01.2019	5.3665	50	268,325.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-28.01.2019	5.3689	50	268,445.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-28.01.2019	132.225	30	396,675.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-28.01.2019	5.3947	50	269,735.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-29.01.2019	5.4307	25	135,767.50 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-29.01.2019	5.4308	75	407,310.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-29.01.2019	129.875	50	649,375.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-29.01.2019	129.9	30	389,700.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-29.01.2019	5.4055	100	540,550.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-29.01.2019	5.4053	45	243,238.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-29.01.2019	5.4052	1	5,405.20 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-29.01.2019	5.405	54	291,870.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-29.01.2019	132.2	40	528,800.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-29.01.2019	132.175	30	396,525.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-30.01.2019	133.45	60	800,700.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-30.01.2019	134.125	2	26,825.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-30.01.2019	134.3	8	107,440.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-30.01.2019	134.325	50	671,625.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-31.01.2019	5.2669	25	131,672.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-31.01.2019	5.2668	10	52,668.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-31.01.2019	5.2667	65	342,335.50 Kısa

XII- PAY ALIM SATIM DEFTERİ

Toplam Pay Adedi	10,000,000,000.00					Pay
Tarih	Pay Alışı	Pay Satışı	Alış Fiyatı	Satış Fiyatı	Dolaşımdaki Pay	Döviz Kodu
02.01.2019			1.239362	1.254759	11,655,725.00	TL
07.01.2019			1.249222	1.248958	11,655,725.00	TL
08.01.2019			1.248958	1.249368	11,655,725.00	TL
14.01.2019		4,517,033.00	1.24711	1.24963	16,172,758.00	TL
15.01.2019			1.24963	1.250677	16,172,758.00	TL
21.01.2019			1.255809	1.25703	16,172,758.00	TL
22.01.2019			1.25703	1.258351	16,172,758.00	TL
28.01.2019			1.263986	1.266114	16,172,758.00	TL
29.01.2019			1.266114	1.266782	16,172,758.00	TL