

ZPE-KATILIMENDKSi HS
MART - 2018 AYLIK 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 : 2.721.930,57
F - TEDAVÜLDEKİ PAY SAYISI : 2.015.174,000
G - FONUN KURULUŞ TARİHİ : 31.08.2015
H - FONUN SÜRESİ : SÜRESİZ
I - AYLIK KORELASYON KATSAYISI : 0,9966

2 - FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A - AY SONU PAY FİYATI : 1,343917
B - ÖNCEKİ AY PAY FİYATI : 1,335640
C - AYLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI : 0,619703
D - YIL BAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI : 0,699772
E - YILLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI : 27,005084
F - AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ
İMKB'de İşlem Gören Hisse Senetleri : 91,023624
Satış Vaadiyle Alış : -3,953935
Katılım Hesabı : 1,720557
Kira Sertifikası Kıymetler : 3,301884
Diğer : 7,907870
G - AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI : 0,000596
H - AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI : 18,025762
I - PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ : 131,177086

3 - FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

A - HİSSE SENETLERİ	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
1. Banka İştirak ve Hissedarları			
2. Diğer Ortaklıklar			
1 AKGUV.E	1.119,000	4.890,03	0,180503
2 ALBRK.E	5.930,000	9.310,10	0,343659
3 EREGL.E	22.911,000	240.107,28	8,862954
4 SASA.E	4.550,000	67.886,00	2,505840
5 SODA.E	21.925,072	121.026,40	4,467384
6 ALKIM.E	1.231,000	28.436,10	1,049647
7 DGATE.E	750,000	9.247,50	0,341348
8 ENKAI.E	35.544,305	195.849,12	7,229276
9 HEKTS.E	4.200,000	45.108,00	1,665048
10 HLGYO.E	7.979,865	7.181,88	0,265101
11 KNFRT.E	730,000	13.870,00	0,511976
12 MAVI.E	2.691,000	145.314,00	5,363900
13 PNSUT.E	1.061,000	12.838,10	0,473886
14 ULUSE.E	1.640,000	30.094,00	1,110844
15 ADANA.E	3.462,000	23.645,46	0,872812
16 ALCTL.E	872,000	6.627,20	0,244626
17 EKGYO.E	88.039,000	222.738,67	8,221836
18 PETKM.E	30.510,000	248.351,40	9,167265
19 EGSR.E	1.349,000	5.315,06	0,196192
20 ERBOS.E	196,000	15.827,00	0,584214
21 ALKA.E	1.971,000	9.322,83	0,344129
22 AYGAZ.E	4.738,000	68.558,86	2,530677
23 CEMTS.E	3.195,000	14.601,15	0,538965
24 EGEEN.E	130,000	49.790,00	1,837872
25 GOODY.E	4.843,982	18.939,97	0,699121
26 LOGO.E	1.016,000	49.743,36	1,836151
27 TTRAK.E	836,000	60.401,00	2,229551
28 VESBE.E	913,000	10.316,90	0,380822
29 AKCNS.E	2.497,000	26.593,05	0,981615
30 BANVT.E	451,000	7.351,30	0,271355
31 BIMAS.E	3.110,000	223.609,00	8,253962
32 BOLUC.E	2.409,000	15.682,59	0,578883
33 ECILC.E	9.940,000	43.040,20	1,588720
34 FROTO.E	3.755,000	233.936,50	8,635176
35 KONYA.E	46,000	11.178,00	0,412608

36 MRDIN.E	2.911,000	13.885,47	0,512547
37 TATGD.E	3.547,000	20.288,84	0,748911
38 PETUN.E	772,000	7.604,20	0,280690
39 SELEC.E	8.794,000	32.713,68	1,207543
40 TKNSA.E	1.785,000	8.103,90	0,299135
41 CUSAN.E	1.205,000	3.193,25	0,117871
42 KARTN.E	66,000	18.750,60	0,692131
43 ORGE.E	30,000	277,50	0,010243
44 YATAS.E	2.444,000	85.540,00	3,157493
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	80.068,65	2,955532
P - EUROBOND	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
R - VADELİ MEVDUAT	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
S - KATILIM HESABI	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)
09.04.2018 3AyaKadarVD-ZKB-TRY	41.966	41.858,35	1,545095
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 02.04.2018	100.099	100.098,63	3,694888
AA - Alış Vaadiyle Satış	Nominal	Rayiç Değer	Oran (%)

4 - FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

	Tutar	Oran (%)
A. FON PORTFÖY DEĞERİ	2.709.111,07	99,529029
B. HAZIR DEĞERLER	8.481,25	0,311590
b) Bankalar	8.481,25	0,311590
c) Hazır Değerler	0,00	0,000000
a) Takastan Alacaklar T1	0,00	0,000000
b) Takastan Alacaklar T2	0,00	0,000000
d) Temettü Alacakları	8.934,42	0,328238
e) Diğer Alacaklar	141,35	0,005193
D. DİĞER VARLIKLAR	0,00	0,000000
b) Geçmiş Yıl Peşin Ödenmiş Vergiler	0,00	0,000000
E. BORÇLAR	4.737,52	0,174050
a) Takasa Borçlar T1	0,00	0,000000
c) Takasa Borçlar	0,00	0,000000
d) Yönetim Ücreti	4.144,84	0,152276
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	0,00	0,000000
k) Diğer Borçlar	456,58	0,016774
FON TOPLAM DEĞERİ	2.721.930,57	100,000000
Toplam Pay Sayısı	6.000.000.000,00	
FİYAT	1,350717	
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	9.075,77	0,333431
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	136,10	0,005000
Dolaşımdaki Pay Sayısı	2.015.174,000	
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	59,14
2 ilan Giderleri	0,00
3 Sigorta Ücretleri	0,00
4 Aracılık Komisyon Giderleri	69,02
4 Döviz aracılık komisyonları	0,00
5 Noter Harç ve Tasdik Ücretleri	0,00
6 Fon Yönetim Ücretleri	128,79
7 Vergi, Resim, Harç vb. Giderler	38,80
8 Metal Saklama Giderleri	0,00
8 Saklama Giderleri	108,24
9 Portföy Yönetim Ücreti	3.715,08
10 IMKB Endeksleri Lisans Ücreti	0,00
11 EFT Masrafı	19,32
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
22.03.2018	TATGD.E	3.098,000	623,89	0,201386 Temettü ödemesi
23.03.2018	TTRAK.E	730,000	4.103,51	5,621241 Temettü ödemesi

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

8 - PORTFÖYDEN SATIŞLAR

Türü	Vade Tarihi	Tanımı	Satış Tarihi	Nominal Değeri	Satış Değeri
HS		DGATE.E	02.03.2018	20,000	308,00
HS		EKGYO.E	02.03.2018	2.570,000	6.656,30
HS		AYGAZ.E	02.03.2018	128,000	1.926,40
HS		EGEEN.E	02.03.2018	4,000	1.330,40
HS		TKNSA.E	02.03.2018	48,000	229,92
HS		BIMAS.E	02.03.2018	84,000	6.102,60
HS		KARTN.E	02.03.2018	2,000	560,20
HS		ORGE.E	02.03.2018	1,000	8,64
HS		ALKIM.E	02.03.2018	15,000	354,90
HS		ALKIM.E	02.03.2018	18,000	425,88
HS		KONYA.E	02.03.2018	1,000	244,20
HS		ECILC.E	02.03.2018	269,000	1.105,59
HS		KNFRT.E	02.03.2018	21,000	365,61
HS		BANVT.E	02.03.2018	13,000	243,36
HS		SASA.E	02.03.2018	118,000	1.191,80
HS		SASA.E	02.03.2018	15,000	151,65
HS		ADANA.E	02.03.2018	94,000	575,28
HS		MAVI.E	02.03.2018	25,000	1.321,25
HS		MAVI.E	02.03.2018	26,000	1.374,10
HS		AKGUV.E	02.03.2018	33,000	150,81
HS		BOLUC.E	02.03.2018	65,000	404,95
HS		ALKA.E	02.03.2018	59,000	255,47
HS		TATGD.E	02.03.2018	6,000	35,94
HS		TATGD.E	02.03.2018	90,000	539,10
HS		ALCTL.E	02.03.2018	25,000	194,50
HS		PETUN.E	02.03.2018	21,000	219,03
HS		SELEC.E	02.03.2018	238,000	844,90
HS		HEKTS.E	02.03.2018	113,000	1.139,04
HS		YATAS.E	02.03.2018	66,000	1.917,96
HS		ULUSE.E	02.03.2018	48,000	933,60
HS		FROTO.E	02.03.2018	101,000	6.130,70
HS		CUSAN.E	02.03.2018	35,000	97,65
HS		PETKM.E	02.03.2018	891,000	7.181,46
HS		AKCNS.E	02.03.2018	68,000	731,00
HS		ENKAI.E	02.03.2018	961,000	5.218,23
HS		EREGL.E	02.03.2018	587,000	6.257,42
HS		HLGYO.E	02.03.2018	233,000	214,36
HS		MRDIN.E	02.03.2018	85,000	360,40

HS	ALBRK.E	02.03.2018	160,000	265,60
HS	PNSUT.E	02.03.2018	29,000	369,75
HS	VESBE.E	02.03.2018	27,000	272,70
HS	LOGO.E	02.03.2018	27,000	1.420,20
HS	SODA.E	02.03.2018	592,000	2.965,92
HS	GOODY.E	02.03.2018	131,000	530,55
HS	TTRAK.E	02.03.2018	23,000	1.782,50
HS	ERBOS.E	02.03.2018	6,000	473,10
HS	EGSER.E	02.03.2018	36,000	144,36
HS	CEMTS.E	02.03.2018	86,000	395,60

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
HS		EKGYO.E	26.03.2018	11.979,000	30.426,66
HS		AYGAZ.E	26.03.2018	600,000	9.570,00
HS		EGEEN.E	26.03.2018	18,000	7.236,00
HS		BIMAS.E	26.03.2018	394,000	28.683,20
HS		ALKIM.E	26.03.2018	56,000	1.336,16
HS		ALKIM.E	26.03.2018	50,000	1.192,00
HS		ALKIM.E	26.03.2018	50,000	1.192,00
HS		ECILC.E	26.03.2018	1.260,000	5.241,60
HS		SASA.E	26.03.2018	619,000	9.804,96
HS		MAVI.E	26.03.2018	341,000	17.902,50
HS		MAVI.E	19.03.2018	217,000	10.969,35
HS		MAVI.E	19.03.2018	86,000	4.347,30
HS		MAVI.E	16.03.2018	400,000	20.520,00
HS		AKGUV.E	26.03.2018	152,000	688,56
HS		ALCTL.E	26.03.2018	119,000	930,58
HS		HEKTS.E	26.03.2018	62,000	694,40
HS		HEKTS.E	26.03.2018	470,000	5.259,30
HS		YATAS.E	26.03.2018	310,000	11.457,60
HS		ULUSE.E	26.03.2018	223,000	4.259,30
HS		FROTO.E	26.03.2018	186,000	11.727,30
HS		FROTO.E	26.03.2018	241,000	15.183,00
HS		FROTO.E	26.03.2018	49,000	3.084,55
HS		CUSAN.E	26.03.2018	164,000	439,52
HS		ENKAI.E	26.03.2018	4.503,000	24.181,11
HS		EREGL.E	26.03.2018	2.910,000	31.078,80
HS		EREGL.E	13.03.2018	1,000	11,00
HS		EREGL.E	12.03.2018	300,000	3.306,00
HS		EREGL.E	07.03.2018	100,000	1.049,00
HS		EREGL.E	07.03.2018	50,000	526,00
HS		EREGL.E	07.03.2018	50,000	526,00
HS		EREGL.E	07.03.2018	200,000	2.104,00
HS		EREGL.E	07.03.2018	50,000	526,00
HS		EREGL.E	07.03.2018	150,000	1.578,00
HS		EREGL.E	07.03.2018	50,000	526,00
HS		EREGL.E	07.03.2018	30,000	315,60
HS		EREGL.E	07.03.2018	20,000	210,40
HS		EREGL.E	07.03.2018	50,000	527,50
HS		EREGL.E	07.03.2018	20,000	211,00
HS		EREGL.E	07.03.2018	17,000	179,35
HS		MRDIN.E	26.03.2018	391,000	1.720,40
HS		MRDIN.E	26.03.2018	5,000	21,95
HS		ALBRK.E	26.03.2018	751,000	1.186,58
HS		PNSUT.E	26.03.2018	134,000	1.638,82
HS		VESBE.E	26.03.2018	124,000	1.411,12
HS		LOGO.E	26.03.2018	39,000	2.028,00
HS		LOGO.E	26.03.2018	90,000	4.680,00
HS		DGATE.E	26.03.2018	95,000	1.304,35
HS		TKNSA.E	26.03.2018	226,000	1.046,38
HS		KARTN.E	26.03.2018	8,000	2.286,40
HS		ORGE.E	26.03.2018	4,000	38,80
HS		KONYA.E	26.03.2018	4,000	987,60
HS		KONYA.E	26.03.2018	2,000	493,60
HS		KNFRT.E	26.03.2018	90,000	1.728,90
HS		KNFRT.E	26.03.2018	9,000	172,80
HS		BANVT.E	26.03.2018	61,000	1.046,15
HS		ADANA.E	26.03.2018	439,000	2.897,40
HS		BOLUC.E	26.03.2018	305,000	1.991,65

HS	ALKA.E	26.03.2018	237,000	1.139,97
HS	TATGD.E	26.03.2018	449,000	2.711,96
HS	PETUN.E	26.03.2018	98,000	955,50
HS	SELEC.E	26.03.2018	1.114,000	4.132,94
KTAL 09.04.2018	3AyaKadarVD-ZKB-TRY	09.03.2018	0,000	41.490,05
HS	PETKM.E	26.03.2018	4.151,000	33.457,06
HS	AKCNS.E	26.03.2018	316,000	3.501,28
HS	HLGYO.E	26.03.2018	1.086,000	988,26
SVDA 02.04.2018	TRD190619T18	30.03.2018	100.619,000	100.000,00
SVDA 30.03.2018	TRD190619T18	29.03.2018	140.760,000	140.000,00
SVDA 29.03.2018	TRD190619T18	28.03.2018	140.790,000	140.000,00
SVDA 28.03.2018	TRD190619T18	27.03.2018	261.553,000	260.000,00
SVDA 27.03.2018	TRD190619T18	26.03.2018	55.275,000	55.000,00
SVDA 26.03.2018	TRD190619T18	23.03.2018	70.393,000	70.000,00
SVDA 23.03.2018	TRD190619T18	22.03.2018	70.378,000	70.000,00
SVDA 22.03.2018	TRD190619T18	21.03.2018	65.330,000	65.000,00
SVDA 21.03.2018	TRD190619T18	20.03.2018	90.485,000	90.000,00
SVDA 20.03.2018	TRD190619T18	19.03.2018	100.589,000	100.000,00
SVDA 19.03.2018	TRD190619T18	16.03.2018	100.689,000	100.000,00
SVDA 16.03.2018	TRD190619T18	15.03.2018	120.504,000	120.000,00
SVDA 15.03.2018	TRD190619T18	14.03.2018	140.839,000	140.000,00
SVDA 14.03.2018	TRD190619T18	13.03.2018	60.215,000	60.000,00
SVDA 13.03.2018	TRD190619T18	12.03.2018	20.098,000	20.000,00
SVDA 12.03.2018	TRD190619T18	09.03.2018	20.108,000	20.000,00
SVDA 09.03.2018	TRD190619T18	08.03.2018	80.259,000	80.000,00
SVDA 08.03.2018	TRD190619T18	07.03.2018	70.208,000	70.000,00
SVDA 07.03.2018	TRD190619T18	06.03.2018	70.164,000	70.000,00
SVDA 06.03.2018	TRD190619T18	05.03.2018	100.124,000	100.000,00
SVDA 05.03.2018	TRD190619T18	02.03.2018	100.285,000	100.000,00
SVDA 02.03.2018	TRD190619T18	01.03.2018	185.477,000	185.000,00
HS	SODA.E	26.03.2018	2.778,000	14.890,08
HS	GOODY.E	26.03.2018	614,000	2.419,16
HS	TTRAK.E	26.03.2018	61,000	4.456,05
HS	TTRAK.E	26.03.2018	36,000	2.628,00
HS	TTRAK.E	26.03.2018	9,000	656,55
HS	ERBOS.E	26.03.2018	27,000	2.170,80
HS	EGSER.E	26.03.2018	171,000	695,97
HS	CEMTS.E	26.03.2018	405,000	1.834,65