

TCD-TACİRLER PORTFÖY DEĞİŞKEN Y.F.
H 2018

VII-PORTFÖYDEN

A) HİSSE SENETLERİ(ALIŞLAR)

KIYMET	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMINAL DEĞERİ
HISSE TÜRK					
GARAN		04/06/18	8.510	851,000.00	100,000.00
ARCLK		07/06/18	15.360	76,800.00	5,000.00
ARCLK		07/06/18	15.320	16,009.40	1,045.00
ARCLK		07/06/18	15.340	69,030.00	4,500.00
ARCLK		07/06/18	15.330	114,285.15	7,455.00
ARCLK		07/06/18	15.350	107,450.00	7,000.00
YKBNK		18/06/18	2.300	621,000.00	270,000.00
ISCTR		27/06/18	5.620	562,000.00	100,000.00
HISSE TÜRK		Toplamı:		2417574.55	495000.00

B) HAZİNE BONOSU VE DEVLET TAHVİLLERİ (ALİŞLAR)

KIYMET	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMINAL DEĞERİ
TAHVİL TÜRK					
TRT240724T15	24/07/24	04/06/18	80.466	643,727.47	800,000.00
TRT240724T15	24/07/24	13/06/18	77.688	155,376.92	200,000.00
TRT080328T15	08/03/28	19/06/18	84.100	336,400.00	400,000.00
TRSKALE62114	17/06/21	21/06/18	100.000	500,000.00	500,000.00
TRSAEST91911	27/09/19	21/06/18	104.366	208,731.40	200,000.00
TAHVİL TÜRK		Toplamı:		1844235.79	2100000.00

A) HİSSE SENETLERİ(SATIŞLAR)

KIYMET	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMINAL DEĞERİ
HISSE TÜRK					
GARAN		25/06/18	8.700	435,000.00	50,000.00
YKBNK		25/06/18	2.420	242,000.00	100,000.00
YKBNK		25/06/18	2.430	413,100.00	170,000.00
GARAN		25/06/18	8.800	440,000.00	50,000.00
HISSE TÜRK		Toplamı:		1530100.00	370000.00

B) HAZİNE BONOSU VE DEVLET TAHVİLLERİ (SATIŞLAR)

KIYMET	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMINAL DEĞERİ
BONO TÜRK					
TRFLDFK91830	14/09/18	06/06/18	95.052	190,104.00	200,000.00
TRFGVYAE1814	05/10/18	06/06/18	94.148	94,148.00	100,000.00
TRFKPTLE1828	15/10/18	06/06/18	93.695	187,390.00	200,000.00
BONO TÜRK		Toplamı:		471642.00	500000.00
TAHVİL TÜRK					
TRSSKFK31912	05/03/19	06/06/18	100.055	400,220.22	400,000.00
TAHVİL TÜRK		Toplamı:		400220.22	400000.00
BONO TÜRK					
TRFLDFK91830	14/09/18	19/06/18	95.392	1,173,321.60	1,230,000.00
BONO TÜRK		Toplamı:		1173321.60	1230000.00
TAHVİL TÜRK					
TRFLDFK31919	22/03/19	19/06/18	104.202	104,201.68	100,000.00
TAHVİL TÜRK		Toplamı:		104201.68	100000.00
BONO TÜRK					
TRFBOLU71811	23/07/18	20/06/18	98.345	491,725.00	500,000.00

TRFANLZ71830	19/07/18	20/06/18	98.706	197,412.00	200,000.00
BONO TÜRK			Toplamı:	689137.00	700000.00
TAHVİL TÜRK					
TRSNTHLA1816	05/12/18	20/06/18	99.800	299,398.70	300,000.00
TRSCLE21918	01/02/19	20/06/18	102.402	286,725.53	280,000.00
TAHVİL TÜRK			Toplamı:	586124.23	580000.00
BONO TÜRK					
TRFDSTF91810	18/09/18	22/06/18	95.345	362,311.00	380,000.00
BONO TÜRK			Toplamı:	362311.00	380000.00

B)HAZİNE BONOSU VE DEVLET TAHVİLLERİ (İTFALAR)

KIYMET	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMINAL DEĞERİ
TAHVİL TÜRK					
TRSLBTV61812	08/06/18	08/06/18	1.030	200,000.00	200,000.00
TRSFINA61816	13/06/18	13/06/18	1.032	200,000.00	200,000.00
TAHVİL TÜRK			Toplamı:	400000.00	400000.00

C) HAZİNE BONOSU VE DEVLET TAHVİLLERİ (SATIŞLAR)

KIYMET	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMINAL DEĞERİ
Y.FONU TÜRK					
TCB-TACIRLER KISA	04/06/18	04/06/18	0.031	379,999.98	12,363,754.00
VAD. BORÇ. ARAÇ. Y.F					
TCB-TACIRLER KISA	05/06/18	05/06/18	0.031	35,000.02	1,138,360.00
VAD. BORÇ. ARAÇ. Y.F					
TCB-TACIRLER KISA	06/06/18	06/06/18	0.031	988,773.45	32,151,052.00
VAD. BORÇ. ARAÇ. Y.F					
Y.FONU TÜRK			Toplamı:	1403773.45	45653166.00

G) TERS REPO

KIYMET	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMINAL DEĞERİ
T.REPO					
TRT110718T18	22/06/18	21/06/18		2,000.00	2,000.00
T.REPO			Toplamı:	2000.00	2000.00

I) BORSA PARA PİYASASI

KIYMET	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMINAL DEĞERİ
BPP					
	04/06/18	01/06/18		268,000.00	
	05/06/18	04/06/18		5,000.00	
	06/06/18	05/06/18		6,000.00	
	07/06/18	06/06/18		67,000.00	
	08/06/18	07/06/18		65,000.00	
	11/06/18	08/06/18		275,000.00	
	12/06/18	11/06/18		7,000.00	
	13/06/18	12/06/18		7,000.00	
	14/06/18	13/06/18		88,000.00	
	18/06/18	14/06/18		88,000.00	
	19/06/18	18/06/18		88,000.00	
	20/06/18	19/06/18		86,000.00	
	21/06/18	20/06/18		9,000.00	
	25/06/18	22/06/18		7,000.00	
	26/06/18	25/06/18		18,000.00	
	27/06/18	26/06/18		50,000.00	
	28/06/18	27/06/18		1,577,000.00	
	29/06/18	28/06/18		1,473,000.00	
	29/06/18	28/06/18		105,000.00	

02/07/18 29/06/18 1,040,000.00

BPP Toplamı: 5329000.00

J) VADELİ İŞLEM VE OPSİYON BORSASI (UZUN)

KIYMET	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMINAL DEĞERİ
FUTURES					
F_XU0300618	29/06/18	04/06/18	123.600	902,280.00	73.00
F_XU0300618	29/06/18	04/06/18	123.575	234,792.50	19.00
F_XU0300618	29/06/18	04/06/18	123.550	98,840.00	8.00
F_XU0300618	29/06/18	04/06/18	123.150	849,735.00	69.00
F_XU0300618	29/06/18	04/06/18	123.125	172,375.00	14.00
F_XU0300618	29/06/18	04/06/18	123.100	209,270.00	17.00
F_XU0300618	29/06/18	19/06/18	114.625	917,000.00	80.00
F_XU0300618	29/06/18	19/06/18	114.550	206,190.00	18.00
F_XU0300618	29/06/18	19/06/18	114.675	252,285.00	22.00
F_USDTRY0618	29/06/18	25/06/18	4.555	819,900.00	180.00
FUTURES					
			Toplamı:	4662667.50	500.00

J) VADELİ İŞLEM VE OPSİYON BORSASI (KISA)

KIYMET	VADE	İŞLEM TARİHİ	FIYAT	İŞLEM DEĞERİ	NOMINAL DEĞERİ
F_USDTRY0618	29/06/18	18/06/18	4.714	150,835.20	32.00
F_USDTRY0618	29/06/18	18/06/18	4.714	117,852.50	25.00
F_USDTRY0618	29/06/18	18/06/18	4.714	155,562.00	33.00
F_USDTRY0618	29/06/18	19/06/18	4.787	201,062.40	42.00
F_USDTRY0618	29/06/18	19/06/18	4.787	110,110.20	23.00
F_USDTRY0618	29/06/18	19/06/18	4.788	119,687.50	25.00
F_XU0300618	29/06/18	20/06/18	116.975	1,169,750.00	100.00
F_XU0300618	29/06/18	20/06/18	116.950	701,700.00	60.00
F_XU0300618	29/06/18	21/06/18	116.650	699,900.00	60.00
F_XU0300618	29/06/18	25/06/18	120.800	604,000.00	50.00
F_XU0300618	29/06/18	25/06/18	121.125	605,625.00	50.00
			Toplamı:	4636084.80	500.00
TOPLAM:				26012393.82	52911166.00