

YATIRIM FONLARI PORTFÖY DAĞILIM RAPORU

Rapor Dönemi 01/09/2018 ve 30/09/2018

I- FONU TANITICI BİLGİLER	
A. FONUN ADI:	GARANTİ PORTFÖY ING BANK ÖZEL BANKACILIK VE PLATİNUM DEĞİŞKEN 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)	34,392,193.80
E. KATILMA PAYI SAYISI :	30,000,555
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ:	22/01/2018
G. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ
II-FONUN PERFORMANS BİLGİLERİ	
A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI:	TL 1.146385
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	1.13647
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	0.87%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYAT ARTIŞ ORANI:	
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
PAY	22.23%
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ	20.23%
ÖZEL SEKTÖR FİNANSMAN BONOSU	6.57%
ÖZEL SEKTÖR VDMK	5.31%
TÜREV TEMİNAT	3.84%
YABANCI HİSSE SENETLERİ	6.18%
TAKASBANK BORSA PARA PİYASASI	33.40%
MEVDUAT	2.24%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	0.33%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse :	1.14%
Özel Borçlanma Araçları Devir Hızı :	0.51%
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:	383.976
H. KATILMA PAYI İHRÇ. NAKİT GİRİŞLERİ:	5,717,683.96
I. KATILMA PAYI İADE. NAKİT ÇIKIŞLARI:	8,521,737.84
J. AYLIK KORELASYON:	
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON:	

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nom.Değ(TL)	Rayiç.Değ(TL)	%
A.PAY			
ENJSA.E	25,000.00	132,250.00	0.38%
ENJSA.E	10,000.00	52,900.00	0.15%
AKBNK.E	35,000.00	242,200.00	0.70%
AKBNK.E	15,000.00	103,800.00	0.30%
AKBNK.E	25,000.00	173,000.00	0.50%
AKBNK.E	10,000.00	69,200.00	0.20%
ASELS.E	3,000.00	82,740.00	0.24%
ASELS.E	5,000.00	137,900.00	0.40%
ASELS.E	2,000.00	55,160.00	0.16%
ASELS.E	7,500.00	206,850.00	0.60%
BIMAS.E	3,000.00	244,050.00	0.71%
BIMAS.E	3,000.00	244,050.00	0.71%
BIMAS.E	2,000.00	162,700.00	0.47%
BIMAS.E	1,000.00	81,350.00	0.24%
BIMAS.E	2,000.00	162,700.00	0.47%
EREGL.E	35,000.00	386,050.00	1.12%
EREGL.E	25,000.00	275,750.00	0.80%
EREGL.E	10,000.00	110,300.00	0.32%
GARAN.E	15,700.00	121,047.00	0.35%
GARAN.E	14,300.00	110,253.00	0.32%
GARAN.E	30,000.00	231,300.00	0.67%
GARAN.E	25,000.00	192,750.00	0.56%
GARAN.E	15,000.00	115,650.00	0.34%
GARAN.E	10,000.00	77,100.00	0.22%
GARAN.E	30,000.00	231,300.00	0.67%
ISCTR.E	15,000.00	66,300.00	0.19%
ISCTR.E	10,000.00	44,200.00	0.13%
ISCTR.E	5,000.00	22,100.00	0.06%
ISCTR.E	40,000.00	176,800.00	0.51%
KCHOL.E	6,000.00	102,360.00	0.30%
KCHOL.E	3,000.00	51,180.00	0.15%
KOZAL.E	4,500.00	231,075.00	0.67%
KOZAL.E	3,000.00	154,050.00	0.45%
KRDMD.E	20,000.00	81,200.00	0.24%
KRDMD.E	20,000.00	81,200.00	0.24%
MAVI.E	3,000.00	107,580.00	0.31%
MAVI.E	3,000.00	107,580.00	0.31%
MAVI.E	2,000.00	71,720.00	0.21%
NTHOL.E	5,000.00	10,450.00	0.03%
NTHOL.E	30,000.00	62,700.00	0.18%
NTHOL.E	40,000.00	83,600.00	0.24%
NTHOL.E	10,000.00	20,900.00	0.06%

SAHOL.E	3,000.00	22,890.00	0.07%
SAHOL.E	5,000.00	38,150.00	0.11%
SAHOL.E	5,000.00	38,150.00	0.11%
SAHOL.E	2,000.00	15,260.00	0.04%
SAHOL.E	30,000.00	228,900.00	0.66%
SAHOL.E	15,000.00	114,450.00	0.33%
TCELL.E	25,000.00	288,500.00	0.84%
THYAO.E	2,700.00	51,543.00	0.15%
THYAO.E	12,300.00	234,807.00	0.68%
THYAO.E	5,000.00	95,450.00	0.28%
TRKCM.E	0.86	3.72	
TTKOM.E	50,000.00	182,000.00	0.53%
TUPRS.E	1,000.00	134,200.00	0.39%
TUPRS.E	1,500.00	201,300.00	0.58%
TUPRS.E	1,000.00	134,200.00	0.39%
TUPRS.E	2,000.00	268,400.00	0.78%
TUPRS.E	1,000.00	134,200.00	0.39%
YKBNK.E	0.8	1.52	
Ana Grup Toplamı	739,501.67	7,659,750.24	22.23%
B.BORÇLANMA ARAÇLARI			
B.1.ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI			
TAHVİL			
TRSATAYE1918	1,500,000.00	1,570,670.07	4.56%
TRSAYGZ12024	125,000.00	128,338.95	0.37%
TRSGZDF51918	500,000.00	507,613.24	1.47%
TRSOPAS22012	1,500,000.00	1,520,556.59	4.41%
TRSORFNE2019	2,000,000.00	2,081,233.47	6.04%
TRSSRTNE1912	1,100,000.00	1,162,034.93	3.37%
Toplam	6,725,000.00	6,970,447.25	20.22%
BONO			
FINANSMAN BONOSU			
TRFFFKR11913	300,000.00	275,703.76	0.80%
TRFISFN11927	1,640,000.00	1,508,802.67	4.38%
TRFTPFCK1810	500,000.00	478,914.45	1.39%
Toplam	2,440,000.00	2,263,420.88	6.57%
GOS(GELİR ORT.SEN)			
GES(GELİRE END.SEN)			
VDMK(VAR DAY MEN K)			
TRPAK3T51916	2,000,000.00	1,828,993.31	5.31%
Toplam	2,000,000.00	1,828,993.31	5.31%
DIŞ BORÇLANMA ARACI			
Ara Grup Toplamı	11,165,000.00	11,062,861.44	32.10%
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	11,165,000.00	11,062,861.44	32.10%
C.KİRA SERTİFİKALARI			
KİRA SERTİFİKASI			
Ç.TÜREV ARAÇLAR			
TÜREV TEMİNAT			
VIOP-TL	1,310,960.76	1,324,000.76	3.84%
Toplam	1,310,960.76	1,324,000.76	3.84%
ALIM OPSİYONU			
Ç.1.VIOP OPSİYON			
VIOP ALIM OPSİYONU			
VIOP SATIM OPSİYONU			
Ana Grup Toplamı	1,310,960.76	1,324,000.76	3.84%
D.YABANCI SERMAYE PİYASASI ARAÇLARI			
YABANCI TAHVİL			
İKRAZ İŞT. SER			
YABANCI KİRA SER			
YP HİSSE			
BORSA YATIRIM FONLARI			
CBU7LN	20	14,635.26	0.04%
CBU7LN	102	74,639.81	0.22%
CSPXLN	237	403,401.33	1.17%
CSPXLN	3	5,106.35	0.01%
CSUUSW	53	87,767.51	0.25%
EIMILN	452	75,243.38	0.22%
EMCRLN	140	81,548.19	0.24%
EMUUSW	5,920.00	210,998.80	0.61%
EMUUSW	292	10,407.37	0.03%
EMUUSW	315	11,227.13	0.03%
IDBTLN	6	4,657.98	0.01%
IDBTLN	95	73,751.34	0.21%
IDTLLN	3,021.00	79,913.68	0.23%
IDTMLN	23	25,799.67	0.07%
IDTMLN	6	6,730.35	0.02%
IDTMLN	5	5,608.62	0.02%
IDTMLN	102	114,415.93	0.33%
IDTPLN	47	57,296.08	0.17%
IDTPLN	5	6,095.33	0.02%
IGLNLN	246	34,496.72	0.10%
IGLNLN	29	4,066.69	0.01%
IJPALN	300	78,998.76	0.23%
IJPALN	18	4,739.93	0.01%

IMBSLN	2,292.00	64,926.99	0.19%
IMBSLN	298	8,441.64	0.02%
IMBSLN	190	5,382.25	0.02%
IMBSLN	4,562.00	129,230.77	0.38%
ISFDLN	1,747.00	55,060.96	0.16%
ISFDLN	579	18,248.60	0.05%
IWDPSW	363	55,437.41	0.16%
IWDPSW	44	6,719.69	0.02%
LQDHLN	10	5,873.39	0.02%
LQDHLN	155	91,037.56	0.26%
SPMVLN	159	51,793.79	0.15%
SPMVLN	513	167,108.25	0.48%
Toplam	22,349.00	2,130,807.51	6.16%
YP VARANT			
Ana Grup Toplamı	22,349.00	2,130,807.51	6.18%
E.ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER			
KIYMETLİ MADEN			
F.VARANTLAR			
G.DİĞER VARLIKLAR			
TERS REPO			
REPO			
TAKASBANK BORSA PARA PIYASASI			
TBPP	1,091,232.88	1,049,503.91	3.05%
TBPP	5,490,410.96	5,244,279.04	15.22%
TBPP	4,398,695.89	4,176,720.53	12.12%
TBPP	1,101,024.66	1,037,129.42	3.01%
Toplam	12,081,364.39	11,507,632.90	33.40%
MEVDUAT			
VADELİ	771,645.48	771,645.48	2.24%
Toplam	771,645.48	771,645.48	2.24%
YP MEVDUAT			
YATIRIM FONU			
GAYRİMENKUL SERTİFİKASI			
Ana Grup Toplamı	12,853,009.87	12,279,278.38	35.63%
FON PORTFOY DEĞERİ	26,090,821.30	34,456,698.34	

IV- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

	Tutarı (TL)	%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:		
B. HAZİR DEĞERLER (+) :	34,456,698.34	100.19%
C. ALACAKLAR (+) :	35,778.42	0.10%
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	286,574.96	0.83%
E. BORÇLAR (-) :	0	
	386,857.92	1.12%

FON TOPLAM DEĞERİ: 34,392,193.80

V- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı (TL)
370.01.000-Fon Yönetim Ücreti	65,868.84
370.02.000-Denetim Ücreti	885.64
370.03.000-Tahvil Borsa Payı	364.76
370.04.000-Aracılık Komisyonu	2,735.01
370.04.200-Brokerage Komisyonu	227.43
370.05.000-Vergi ve Resim Harç	38.8
370.06.000-Saklama Giderleri	2,092.53
370.15.001-BPP Kom	84
370.20.001-SPK Kayda Alma Mas	436.95
370.23.000-Futures İşlemi Kom	828.43
370.27.000-BPP İşlem Masrafı	20.27
370.28.000-Portföy Saklama Gideri	2,291.61
370.33.000-Borsa Futures İşlemi Kom	604.71
370.99.000-Diger Giderler	169.63
TOPLAM	76,648.61

VI- GEÇEN AY İÇİNDE

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

Açıklama

ASELS Tem:% 2

TCELL Tem:% 29

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_USDTRY1018-GRM	VIOP-04.09.2018	6.8725	100	687,250.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-05.09.2018	117.9	13	153,270.00	Kısa

Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-05.09.2018	117.875	37	436,137.50	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-07.09.2018	117.15	22	257,730.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-07.09.2018	117.175	9	105,457.50	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-07.09.2018	117.2	19	222,680.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-10.09.2018	116.425	100	1,164,250.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-13.09.2018	6.4829	1	6,482.90	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-13.09.2018	6.4826	57	369,508.20	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-13.09.2018	6.4819	192	1,244,524.80	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-13.09.2018	116.725	75	875,437.50	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-13.09.2018	116.7	25	291,750.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-13.09.2018	119	2	23,800.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-13.09.2018	119.025	48	571,320.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-13.09.2018	119.05	50	595,250.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-14.09.2018	120.825	20	241,650.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-14.09.2018	121.55	40	486,200.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-17.09.2018	6.3677	50	318,385.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-18.09.2018	120.425	18	216,765.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-18.09.2018	120.45	172	2,071,740.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-18.09.2018	120.425	50	602,125.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-18.09.2018	120.35	20	240,700.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-19.09.2018	121.15	5	60,575.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-19.09.2018	121.175	25	302,937.50	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-20.09.2018	6.2287	50	311,435.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-20.09.2018	6.2234	2	12,446.80	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-20.09.2018	6.2227	48	298,689.60	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-20.09.2018	123.425	50	617,125.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-21.09.2018	123.775	20	247,550.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-21.09.2018	123.75	56	693,000.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-21.09.2018	123.725	24	296,940.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-27.09.2018	127.325	10	127,325.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-27.09.2018	127.35	10	127,350.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-27.09.2018	127.375	30	382,125.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-27.09.2018	127.35	20	254,700.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-27.09.2018	127.375	4	50,950.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-27.09.2018	127.4	26	331,240.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-27.09.2018	127.5	7	89,250.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-27.09.2018	127.525	43	548,357.50	Uzun

XII- PAY ALIM SATIM DEFTERİ

Toplam Pay Adedi 10,000,000,000.00

Tarih	Pay Alışı	Pay Satışı	Alış Fiyatı	Satış Fiyatı	Dolaşımdaki Pay	Pay Döviz Kodu
03.09.2018		438,980.00	1.129881	1.13647	32,885,089.00	TL
04.09.2018			1.13647	1.138975	32,873,520.00	TL
05.09.2018	11,569.00	28,530.00	1.138975	1.139	32,892,224.00	TL
06.09.2018	9,826.00	219,121.00	1.139	1.136947	32,854,600.00	TL
07.09.2018	256,745.00	301,486.00	1.136947	1.139353	33,067,186.00	TL
10.09.2018	88,900.00	753,262.00	1.139353	1.133239	33,809,748.00	TL
11.09.2018	10,700.00	823,357.00	1.133239	1.131219	34,482,528.00	TL
12.09.2018	150,577.00	538,357.00	1.131219	1.133059	34,540,317.00	TL
13.09.2018	480,568.00	948,599.00	1.133059	1.132206	35,484,408.00	TL
14.09.2018	4,508.00	314,042.00	1.132206	1.134197	35,498,524.00	TL
17.09.2018	299,926.00		1.134197	1.132303	35,199,710.00	TL
18.09.2018	298,814.00	44,028.00	1.132303	1.135621	35,243,738.00	TL
19.09.2018		175,259.00	1.135621	1.137615	31,918,414.00	TL
20.09.2018	3,500,583.00		1.137615	1.138406	31,562,226.00	TL
21.09.2018	356,188.00	70,299.00	1.138406	1.137982	31,476,231.00	TL
24.09.2018	156,294.00	43,710.00	1.137982	1.143887	31,519,941.00	TL
25.09.2018			1.143887	1.145368	31,396,094.00	TL
26.09.2018	123,847.00	263,054.00	1.145368	1.1436	31,659,148.00	TL
27.09.2018			1.1436	1.144303	29,923,539.00	TL
28.09.2018	1,735,609.00	77,016.00	1.144303	1.146013	30,000,555.00	TL