

YATIRIM FONLARI PORTFÖY DAĞILIM RAPORU

Rapor Dönemi 01/02/2019 ve 28/02/2019

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) 19,556,472.04
 E. KATILMA PAYI SAYISI : 15,272,758
 F. FONUN KURULUŞ TARİHİ: 29/09/2017
 G. FONUN SÜRESİ: SÜRESİZ

II-FONUN PERFORMANS BİLGİLERİ

TL
 A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI: 1.280481
 B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI: 1.266374
 C.AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI: 1.11%
 Ç.YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI: 2.07%
 D.YILLIK KATILMA PAYI FİYAT ARTIŞ ORANI: 19.34%
 E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:
 PAY 7.19%
 ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ 64.69%
 TÜREV TEMİNAT 1.71%
 TERS REPO 26.41%
 F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI: 0.16%
 G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:
 Hisse : 1.36%
 Özel Borçlanma Araçları Devir Hızı : 0.08%
 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: 638.196
 H.KATILMA PAYI İHRÇ. NAKİT GİRİŞLERİ:
 I.KATILMA PAYI İADE. NAKİT ÇIKIŞLARI: 1,142,697.10
 J. AYLIK KORELASYON:
 K. ÜÇ AYLIK KORELASYON:

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nom.Değ(TL)	Rayiç.Değ(TL)	%
A.PAY			
AKSA.E	9,500.00	89,490.00	0.46%
AKSA.E	1,500.00	14,130.00	0.07%
EREGL.E	25,000.00	233,000.00	1.19%
EREGL.E	25,000.00	233,000.00	1.19%
KOZAL.E	3,000.00	146,940.00	0.75%
MGROS.E	12,500.00	196,250.00	1.00%
NTHOL.E	30,000.00	55,200.00	0.28%
NTHOL.E	70,000.00	128,800.00	0.66%
TTKOM.E	30,000.00	162,900.00	0.83%
YATAS.E	25,000.00	146,250.00	0.75%
Ana Grup Toplamı	231,500.00	1,405,960.00	7.18%
B.BORÇLANMA ARAÇLARI			
B.1.ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI			
TAHVİL			
TRSENSA32314	2,000,000.00	2,370,427.40	12.12%
TRSENSA32314	2,000,000.00	2,370,427.40	12.12%
TRSGZDF51918	400,000.00	394,519.53	2.02%
TRSKCTF32014	400,000.00	402,968.18	2.06%
TRSKCTF71913	2,250,000.00	2,225,233.32	11.38%
TRSRNSHE1916	3,000,000.00	3,092,542.04	15.81%
TRSSRTNE1912	25,000.00	25,663.58	0.13%
TRSTHALE2716	750,000.00	756,544.20	3.87%
TRSTPRS22114	1,000,000.00	1,014,132.31	5.19%
Toplam	11,825,000.00	12,652,457.96	64.70%
BONO			
FINANSMAN BONOSU			
GOS(GELİR ORT.SEN)			
GES(GELİRE END.SEN)			
VDMK(VAR DAY MEN K)			
DIŞ BORÇLANMA ARACI			
Ara Grup Toplamı	11,825,000.00	12,652,457.96	64.69%
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	11,825,000.00	12,652,457.96	64.69%
C.KİRA SERTİFİKALARI			
KİRA SERTİFİKASI			
Ç.TÜREV ARAÇLAR			
TÜREV TEMİNAT			
VIOP-TL	334,369.49	334,879.49	1.71%
Toplam	334,369.49	334,879.49	1.71%
ALIM OPSİYONU			
Ç.1.VIOP OPSİYON			
VIOP ALIM OPSİYONU			
VIOP SATIM OPSİYONU			

Ana Grup Toplamı	334,369.49	334,879.49	1.71%
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	161,097.04	161,097.04	0.82%
TRT110320T18	5,003,287.67	5,003,287.67	25.58%
Toplam	5,164,384.71	5,164,384.71	26.40%
REPO			
TAKASBANK BORSA PARA PİYASASI			
MEVDUAT			
YP MEVDUAT			
YATIRIM FONU			
GAYRİMENKUL SERTİFİKASI			
Ana Grup Toplamı	5,164,384.71	5,164,384.71	26.40%
FON PORTFOY DEĞERİ	17,555,254.20	19,557,682.16	

IV- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

	Tutarı (TL)	%	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	19,557,682.16	100.01%	
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	10,172.65	0.05%	
C. ALACAKLAR (+) :	0		
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0		
E. BORÇLAR (-) :	11,382.77	0.06%	
FON TOPLAM DEĞERİ:	19,556,472.04		

V- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı (TL)
370.01.000-Fon Yönetim Ücreti	3,835.23
370.03.000-Tahvil Borsa Payı	235.06
370.04.000-Aracılık Komisyonu	567.1
370.04.200-Brokerage Komisyonu	134.31
370.05.000-Vergi ve Resim Harç	122.9
370.06.000-Saklama Giderleri	798.4
370.09.000-Noter Masrafları	292.07
370.20.001-SPK Kayda Alma Mas	288.29
370.23.000-Futures İşlemi Kom	760.79
370.28.000-Portföy Saklama Gideri	1,227.15
370.33.000-Borsa Futures İşlemi Kom	529.17
370.99.000-Diger Giderler	169.63
TOPLAM	8,960.10

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-01.02.2019	5.2886	1	5,288.60	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-01.02.2019	5.2887	2	10,577.40	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-01.02.2019	5.289	147	777,483.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-01.02.2019	131.925	12	158,310.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-01.02.2019	131.825	78	1,028,235.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-01.02.2019	5.2895	50	264,475.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-05.02.2019	131.75	50	658,750.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-05.02.2019	132.075	34	449,055.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-05.02.2019	132.1	16	211,360.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-06.02.2019	130.725	50	653,625.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-06.02.2019	130.7	34	444,380.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-06.02.2019	130.725	16	209,160.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-12.02.2019	5.2995	4	21,198.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-12.02.2019	5.2991	1	5,299.10	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-12.02.2019	5.299	195	1,033,305.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-13.02.2019	129.4	100	1,294,000.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-14.02.2019	5.3456	150	801,840.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-15.02.2019	5.2924	25	132,310.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-15.02.2019	5.292	15	79,380.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-15.02.2019	5.2919	10	52,919.00	Kısa

Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-15.02.2019	5.2928	25	132,320.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-15.02.2019	5.2924	25	132,310.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-18.02.2019	5.3288	38	202,494.40 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-18.02.2019	5.3291	62	330,404.20 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-20.02.2019	128.475	60	770,850.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300219-GRM	VIOP-20.02.2019	128.5	40	514,000.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300419-GRM	VIOP-20.02.2019	131.25	30	393,750.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300419-GRM	VIOP-20.02.2019	131.2	30	393,600.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300419-GRM	VIOP-20.02.2019	131.225	20	262,450.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300419-GRM	VIOP-20.02.2019	131.275	20	262,550.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300419-GRM	VIOP-22.02.2019	132.075	20	264,150.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300419-GRM	VIOP-25.02.2019	133.7	41	548,170.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300419-GRM	VIOP-25.02.2019	133.725	1	13,372.50 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300419-GRM	VIOP-25.02.2019	133.825	8	107,060.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0219-GRM	VIOP-27.02.2019	5.2985	150	794,775.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0419-GRM	VIOP-27.02.2019	5.46	150	819,000.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300419-GRM	VIOP-28.02.2019	133.425	30	400,275.00 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	
04.02.2019			1.266374	1.265997	15,972,758.00	TL	
05.02.2019	200,000.00		1.265997	1.268537	15,972,758.00	TL	
11.02.2019			1.268252	1.268855	15,972,758.00	TL	
12.02.2019			1.268855	1.272425	15,972,758.00	TL	
18.02.2019			1.270166	1.270711	15,272,758.00	TL	
19.02.2019	700,000.00		1.270711	1.271983	15,272,758.00	TL	
25.02.2019			1.275435	1.278356	15,272,758.00	TL	
26.02.2019			1.278356	1.278149	15,272,758.00	TL	