

YATIRIM FONLARI PORTFÖY DAĞILIM RAPORU

Rapor Dönemi 01/02/2020 ve 29/02/2020

I- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI:	GARANTİ PORTFÖY EUROBOND BORÇLANMA ARAÇLARI (DÖVİZ) FONU
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)	101,598,756.51
E. KATILMA PAYI SAYISI :	46,310,572.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ:	01.08.2016
G. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

II-FONUN PERFORMANS BİLGİLERİ

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI:	2.193857
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	2.236706
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	-0.92%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	2.14%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYAT ARTIŞ ORANI:	23.54%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
ÖZEL SEKTÖR DIŞ BORÇLANMA ARACI	17.12%
KAMU SEKTÖRÜ DIŞ BORÇLANMA ARACI	81.69%
TERS REPO	1.18%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	0.45%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse :	0.00%
Özel Borçlanma Araçları Devir Hızı :	0.00%
Kamu Borçlanma Araçları Devir Hızı :	0.62%
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:	2543.477
H.KATILMA PAYI İHRÇ. NAKİT GİRİŞLERİ:	56,234,955.33
I.KATILMA PAYI İADE. NAKİT ÇIKIŞLARI:	25,686,152.79
J. AYLIK KORELASYON:	
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON:	

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nom.Deg(TL)	Rayiç.Deg(TL)	%
A.PAY			
B.BORÇLANMA ARAÇLARI			
B.1.ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI			
TAHVİL			
BONO			
FINANSMAN BONOSU			
GOS(GELİR ORT.SEN)			
GES(GELİRE END.SEN)			
VDMK(VAR DAY MEN K)			
DIŞ BORÇLANMA ARACI			
XS1508390090	200,000.00	1,273,745.67	1.28%
XS1508390090	200,000.00	1,273,745.67	1.28%
XS1576037284	400,000.00	2,574,825.54	2.58%
XS1578203462	400,000.00	2,505,845.06	2.51%
XS1584113184	300,000.00	1,893,888.90	1.90%
XS1634372954	400,000.00	2,469,204.39	2.48%
XS1760780731	500,000.00	3,091,878.44	3.10%
XS1970705528	293,000.00	1,981,736.58	1.99%
Toplam	2,693,000.00	17,064,870.25	17.12%
Ara Grup Toplamı	2,693,000.00	17,064,870.25	17.11%
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			
US900123AL40	40,000.00	348,083.59	0.35%
US900123AW05	500,000.00	3,349,303.84	3.36%
US900123AY60	25,000.00	159,794.57	0.16%
US900123AY60	200,000.00	1,278,356.58	1.28%
US900123BB58	5,000.00	33,466.36	0.03%
US900123BG46	500,000.00	3,086,203.53	3.10%
US900123BH29	4,000.00	25,850.91	0.03%
US900123BJ84	500,000.00	2,825,493.97	2.83%
US900123BJ84	1,000,000.00	5,650,987.94	5.67%
US900123BY51	100,000.00	641,338.05	0.64%
US900123BZ27	74,000.00	488,389.54	0.49%
US900123BZ27	97,000.00	640,186.29	0.64%
US900123CA66	125,000.00	753,792.28	0.76%
US900123CB40	100,000.00	515,710.60	0.52%
US900123CF53	150,000.00	966,525.21	0.97%
US900123CF53	200,000.00	1,288,700.29	1.29%
US900123CJ75	30,000.00	174,606.42	0.18%
US900123CJ75	30,000.00	174,606.42	0.18%
US900123CJ75	26,000.00	151,325.57	0.15%
US900123CJ75	134,000.00	779,908.69	0.78%
US900123CJ75	200,000.00	1,164,042.83	1.17%
US900123CK49	200,000.00	1,195,987.92	1.20%
US900123CK49	400,000.00	2,391,975.84	2.40%
US900123CL22	200,000.00	1,270,133.41	1.27%
US900123CP36	600,000.00	3,523,615.34	3.53%
US900123CQ19	200,000.00	1,261,470.69	1.27%
US900123CQ19	400,000.00	2,522,941.38	2.53%
US900123CQ19	1,000,000.00	6,307,353.45	6.33%
US900123CR91	200,000.00	1,342,290.34	1.35%
US900123CT57	100,000.00	686,125.93	0.69%
US900123CT57	500,000.00	3,430,629.66	3.44%
US900123CV04	1,000,000.00	6,433,465.28	6.45%
US900123CV04	800,000.00	5,146,772.22	5.16%
US900123CW86	300,000.00	1,898,072.70	1.90%
US900123CW86	1,000,000.00	6,326,909.00	6.35%
US900123CW86	400,000.00	2,530,763.60	2.54%
US900123CX69	2,000,000.00	11,701,205.50	11.74%
XS0503454166	100,000.00	718,503.26	0.72%
XS0993155398	100,000.00	719,958.09	0.72%
US900123BG4620200302	-400,000.00	-2,469,428.52	-2.48%
Toplam	13,140,000.00	81,435,418.57	81.69%

Ara Grup Toplamı	13,140,000.00	81,435,418.57	81.69%
Ana Grup Toplamı	15,833,000.00	98,500,288.82	98.81%
C.KİRA SERTİFİKALARI			
KİRA SERTİFİKASI			
Ç.TÜREV ARAÇLAR			
TÜREV TEMİNAT			
VIOP-TL	2,352.16	2,352.16	
Toplam	2,352.16	2,352.16	
ALIM OPSİYONU			
Ç.1.VIOP OPSİYON			
VIOP ALIM OPSİYONU			
VIOP SATIM OPSİYONU			
Ana Grup Toplamı	2,352.16	2,352.16	
D.YABANCI SERMAYE PİYASASI ARAÇLARI			
YABANCI TAHVİL			
İKRAZ İŞT. SER			
YABANCI KİRA SER			
YP HİSSE			
BORSA YATIRIM FONLARI			
YP VARANT			
E.ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER			
KIYMETLİ MADEN			
F.VARANTLAR			
G.DİĞER VARLIKLAR			
TERS REPO			
TRT041126T11	1,000,892.60	1,000,892.60	1.00%
TRT140623T19	180,147.95	180,147.95	0.18%
Toplam	1,181,040.55	1,181,040.55	1.18%
REPO			
TAKASBANK BORSA PARA PİYASASI			
MEVDUAT			
YP MEVDUAT			
YATIRIM FONU			
GAYRİMENKUL SERTİFİKASI			
Ana Grup Toplamı	1,181,040.55	1,181,040.55	1.18%
FON PORTFOY DEĞERİ	17,016,392.71	99,683,681.54	

IV- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

	Tutarı (TL)	%	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:			
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	99,683,681.54	98.12%	
C. ALACAKLAR (+) :	11,498.85	0.01%	
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	4,875,463.42	4.80%	
E. BORÇLAR (-) :	0		
	2,971,887.30	2.93%	
FON TOPLAM DEĞERİ:	101,598,756.51		

V- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı (TL)	
370.01.000-Fon Yönetim Ücreti	97,933.18	
370.02.000-Denetim Ücreti	481.04	
370.03.000-Tahvil Borsa Payı	1,328.90	
370.04.200-Brokerage Komisyonu	759.36	
370.05.000-Vergi ve Resim Harç	15,631.32	
370.06.000-Saklama Giderleri	3,469.04	
370.09.000-Noter Masrafları	358.75	
370.15.001-BPP Kom	510.31	
370.20.001-SPK Kayda Alma Mas	2,126.23	
370.27.000-BPP İşlem Masrafı	70.46	
370.28.000-Portföy Saklama Gideri	6,259.13	
370.99.000-Diger Giderler	1,062.00	
TOPLAM	129,989.72	

VI- GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI 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 VADELİ İŞLEM SÖZLEŞMELERİ

Sermaye Piyasası Aracı	ISIN	İşlem Tarihi	Fiyat	Nominal	Cari Piyasa Değeri	Kısa/Uzun
Forward Sözleşmesi	USD/TL	04.02.2020	5.989	1,010,000.00	6,048,890.00	USD Alış
Forward Sözleşmesi	USD/TL	05.02.2020	5.991	1,000,000.00	5,991,000.00	USD Alış
Forward Sözleşmesi	USD/TL	06.02.2020	5.9875	1,000,000.00	5,987,500.00	USD Alış
Forward Sözleşmesi	USD/TL	07.02.2020	6.0025	1,400,000.00	8,403,500.00	USD Alış
Forward Sözleşmesi	USD/TL	19.02.2020	6.073	850,000.00	5,162,050.00	USD Alış
Forward Sözleşmesi	USD/TL	25.02.2020	6.1395	400,000.00	2,455,800.00	USD Alış
Forward Sözleşmesi	USD/TL	26.02.2020	6.1545	3,077,250.00	500,000.00	USD Satış
Forward Sözleşmesi	USD/TL	28.02.2020	6.225	2,427,750.00	390,000.00	USD Satış

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
03.02.2020		1,292,546.00	1,331,841.00	2.23408	2.236706	32,761,708.00 TL
04.02.2020		108,920.00	1,985,549.00	2.236706	2.240628	34,566,328.00 TL
05.02.2020		180,929.00	4,143,738.00	2.240628	2.234712	38,597,053.00 TL
06.02.2020		113,013.00	4,024,660.00	2.234712	2.234716	42,385,690.00 TL
07.02.2020		236,023.00	3,301,507.00	2.234716	2.236481	45,303,300.00 TL
10.02.2020		383,897.00	963,904.00	2.236481	2.231094	46,044,508.00 TL
11.02.2020		222,696.00	1,400,740.00	2.231094	2.201799	46,891,199.00 TL
12.02.2020		554,049.00	260,086.00	2.201799	2.219818	46,139,522.00 TL
13.02.2020		1,011,763.00	945,410.00	2.219818	2.225712	46,431,385.00 TL
14.02.2020		653,547.00	652,175.00	2.225712	2.225574	46,889,852.00 TL
17.02.2020		193,708.00	197,722.00	2.225574	2.233507	46,462,006.00 TL

18.02.2020	625,568.00	717,488.00	2.233507	2.229415	46,890,313.00 TL
19.02.2020	289,181.00	640,696.00	2.229415	2.238557	47,082,406.00 TL
20.02.2020	448,603.00	560,068.00	2.238557	2.237613	47,331,848.00 TL
21.02.2020	310,626.00	1,145,043.00	2.237613	2.223725	48,041,979.00 TL
24.02.2020	434,912.00	367,808.00	2.223725	2.234526	47,688,121.00 TL
25.02.2020	721,666.00	800,016.00	2.234526	2.23876	47,838,636.00 TL
26.02.2020	649,501.00	617,484.00	2.23876	2.224491	45,797,719.00 TL
27.02.2020	2,658,401.00	515,784.00	2.224491	2.229016	45,876,570.00 TL
28.02.2020	436,933.00	625,248.00	2.229016	2.223955	46,310,572.00 TL