

YATIRIM FONLARI PORTFÖY DAĞILIM RAPORU

Rapor Dönemi

01/02/2020 ve 29/02/2020

I- FONUN 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)	23,752,740.84
E. KATILMA PAYI SAYISI :	15,194,758.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ:	29/09/2017
G. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

II-FONUN PERFORMANS BİLGİLERİ

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI:	1.563219
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	1.561579
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	-0.25%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	0.92%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYAT ARTIŞ ORANI:	22.08%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
PAY	29.35%
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ	37.85%
ÖZEL SEKTÖR DIŞ BORÇLANMA ARACI	13.28%
TÜREV TEMİNAT	6.24%
TERS REPO	13.29%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	0.15%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse :	0.00%
Özel Borçlanma Araçları Devir Hızı :	0.00%
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:	694.552
H. KATILMA PAYI İHRÇ. NAKİT GİRİŞLERİ:	
I. KATILMA PAYI İADE. NAKİT ÇIKIŞLARI:	
J. AYLIK KORELASYON:	
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON:	

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nom. Değ(TL)	Rayiç. Değ(TL)	%
A. PAY			
GARAN.E	30,000.00	285,000.00	1.20%
GARAN.E	38,000.00	361,000.00	1.52%
INDES.E	65,000.00	689,000.00	2.90%
KOZAL.E	8,000.00	584,000.00	2.46%
KOZAL.E	1,000.00	73,000.00	0.31%
KOZAL.E	1,000.00	73,000.00	0.31%
KRDM.D.E	121,000.00	314,600.00	1.33%
KRDM.D.E	151,000.00	392,600.00	1.65%
MAV.E	14,000.00	749,000.00	3.16%
SAHOL.E	80,000.00	680,800.00	2.87%
THYAO.E	57,000.00	669,750.00	2.82%
TOASO.E	12,000.00	318,720.00	1.34%
TOASO.E	13,000.00	345,280.00	1.45%
TOASO.E	4,000.00	106,240.00	0.45%
ULKER.E	33,000.00	675,840.00	2.85%
VAKBN.E	60,000.00	318,000.00	1.34%
VAKBN.E	62,000.00	328,600.00	1.38%
Ana Grup Toplamı	750,000.00	6,964,430.00	29.34%
B. BORÇLANMA ARAÇLARI			
B.1. ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI			
TAHVİL			
TRSENSA32314	2,000,000.00	2,717,466.87	11.45%
TRSENSA32314	2,000,000.00	2,717,466.87	11.45%
TRSHEKT32123	500,000.00	515,984.75	2.17%
TRSKCTF32014	400,000.00	426,819.66	1.80%
TRSOTKO32110	800,000.00	841,865.55	3.55%
TRSTHALE2716	750,000.00	749,544.75	3.16%
TRSTPRS22114	1,000,000.00	1,012,676.48	4.27%
Toplam	7,450,000.00	8,981,824.93	37.85%
BONO			
FINANSMAN BONOSU			
GOS(GELİR ORT.SEN)			
GES(GELİRE END.SEN)			
VDMK(VAR DAY MEN K)			
DIŞ BORÇLANMA ARACI			
XS1079527211	300,000.00	1,891,373.01	7.97%
XS1079527211	200,000.00	1,260,915.34	5.31%
Toplam	500,000.00	3,152,288.35	13.28%
Ara Grup Toplamı	7,950,000.00	12,134,113.28	51.13%
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	7,950,000.00	12,134,113.28	51.13%
C. KİRA SERTİFİKALARI			

KIRA SERTİFİKASI						
Ç.TÜREV ARAÇLAR						
TÜREV TEMİNAT						
VIOP-TL	1,277,927.19	1,479,987.19	6.24%			
Toplam	1,277,927.19	1,479,987.19	6.24%			
ALIM OPSİYONU						
Ç.1.VIOP OPSİYON						
VIOP ALIM OPSİYONU						
VIOP SATIM OPSİYONU						
Ana Grup Toplamı	1,277,927.19	1,479,987.19	6.23%			
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						
TRT020823T11	3,002,712.33	3,002,712.33	12.65%			
TRT290125T15	150,123.29	150,123.29	0.63%			
Toplam	3,152,835.62	3,152,835.62	13.28%			
REPO						
TAKASBANK BORSA PARA PİYASASI						
MEVDUAT						
YP MEVDUAT						
YATIRIM FONU						
GAYRİMENKUL SERTİFİKASI						
Ana Grup Toplamı	3,152,835.62	3,152,835.62	13.28%			
FON PORTFOY DEĞERİ	13,130,762.81	23,731,366.09				
IV- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU						
	Tutarı (TL)	%				
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	23,731,366.09	99.91%				
B. HAZİR DEĞERLER (+) :	30,407.42	0.13%				
C. ALACAKLAR (+) :	0					
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0					
E. BORÇLAR (-) :	9,032.67	0.04%				
FON TOPLAM DEĞERİ:	23,752,740.84					
V- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER						
Açıklama	Tutarı (TL)					
370.01.000-Fon Yönetim Ücreti	4,747.16					
370.02.000-Denetim Ücreti	481.04					
370.03.000-Tahvil Borsa Payı	464.00					
370.04.200-Brokerage Komisyonu	265.16					
370.05.000-Vergi ve Resim Harç	150.50					
370.06.000-Saklama Giderleri	888.30					
370.09.000-Noter Masrafları	358.75					
370.20.001-SPK Kayda Alma Mas	365.88					
370.23.000-Futures İşlemi Kom	735.56					
370.28.000-Portföy Saklama Gideri	1,514.81					
370.33.000-Borsa Futures İşlemi Kom	540.93					
TOPLAM	10,512.09					
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- ÖDÜNÇ 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_XU0300420-GRM	VIOP-24.02.2020	138.6	15	207,900.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-24.02.2020	138.575	2	27,715.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-24.02.2020	138.575	50	692,875.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.125	8	108,900.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.125	6	81,675.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.125	2	27,225.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.125	16	217,800.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.15	5	68,075.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.15	1	13,615.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.15	54	735,210.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.125	1	13,612.50	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.125	2	27,225.00	Uzun

Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.125	4	54,450.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.125	1	13,612.50 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.125	30	408,375.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.125	11	149,737.50 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.075	4	54,430.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.075	1	13,607.50 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.075	10	136,075.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.1	10	136,100.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.1	19	258,590.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.1	1	13,610.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.1	1	13,610.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.1	20	272,200.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-24.02.2020	138.525	2	27,705.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-24.02.2020	138.525	11	152,377.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-24.02.2020	138.525	35	484,837.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.075	8	108,860.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.075	1	13,607.50 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.075	1	13,607.50 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.075	1	13,607.50 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.075	8	108,860.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.075	10	136,075.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.075	3	40,822.50 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.075	15	204,112.50 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-24.02.2020	138.5	34	470,900.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-24.02.2020	138.5	1	13,850.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-24.02.2020	138.475	1	13,847.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-24.02.2020	138.475	1	13,847.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-24.02.2020	138.475	10	138,475.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-24.02.2020	138.475	48	664,680.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-24.02.2020	138.475	8	110,780.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-24.02.2020	138.475	8	110,780.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-24.02.2020	138.475	8	110,780.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-24.02.2020	138.475	28	387,730.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-24.02.2020	138.45	10	138,450.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-24.02.2020	138.45	50	692,250.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-24.02.2020	138.45	28	387,660.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.125	6	81,675.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.15	2	27,230.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.125	51	694,237.50 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.075	2	27,215.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.1	32	435,520.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300220-GRM	VIOP-24.02.2020	136.075	53	721,197.50 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-24.02.2020	138.575	13	180,147.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-24.02.2020	138.525	25	346,312.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-24.02.2020	138.45	12	166,140.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0220-GRM	VIOP-25.02.2020	6.14	200	1,228,000.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0420-GRM	VIOP-25.02.2020	6.2619	5	31,309.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0420-GRM	VIOP-25.02.2020	6.2605	5	31,302.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0420-GRM	VIOP-25.02.2020	6.2601	5	31,300.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0420-GRM	VIOP-25.02.2020	6.26	134	838,840.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0420-GRM	VIOP-25.02.2020	6.2605	1	6,260.50 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0420-GRM	VIOP-25.02.2020	6.26	50	313,000.00 Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-27.02.2020	137.5	1	13,750.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-27.02.2020	137.5	1	13,750.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-27.02.2020	137.5	2	27,500.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-27.02.2020	137.5	10	137,500.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-27.02.2020	137.5	2	27,500.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-27.02.2020	137.5	2	27,500.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-27.02.2020	137.5	4	55,000.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-27.02.2020	137.5	4	55,000.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-27.02.2020	137.5	2	27,500.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-27.02.2020	137.5	7	96,250.00 Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0300420-GRM	VIOP-27.02.2020	137.5	15	206,250.00 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
03.02.2020			1.560198	1.561579	15,194,758.00	TL
04.02.2020			1.561579	1.562575	15,194,758.00	TL
10.02.2020			1.569571	1.571327	15,194,758.00	TL
11.02.2020			1.571327	1.566266	15,194,758.00	TL
17.02.2020			1.576119	1.582363	15,194,758.00	TL
18.02.2020			1.582363	1.585267	15,194,758.00	TL
24.02.2020			1.571289	1.575635	15,194,758.00	TL
25.02.2020			1.575635	1.577037	15,194,758.00	TL