

YATIRIM FONLARI PORTFÖY DAĞILIM RAPORU

Rapor Dönemi 01/09/2020 ve 30/09/2020

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) 100000000
 D. TOPLAM DEĞER: (TL) 25,311,028.04
 E. KATILMA PAYI SAYISI : 14,864,300.00
 F. FONUN KURULUŞ TARİHİ: 29/09/2017
 G. FONUN SÜRESİ: SÜRESİZ

II-FONUN PERFORMANS BİLGİLERİ

TL
 A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI: 1.702807
 B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI: 1.658619
 C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI: 2.68%
 Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI: 9.93%
 D. YILLIK KATILMA PAYI FİYAT ARTIŞ ORANI: 16.95%
 E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:
 ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ 35.09%
 ÖZEL SEKTÖR DIŞ BORÇLANMA ARACI 39.39%
 KAMU SEKTÖRÜ DIŞ BORÇLANMA ARACI 15.22%
 TÜREV TEMİNAT 5.40%
 TERS REPO 4.90%
 F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI: 0.18%
 G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:
 Hisse : 0.00%
 Özel Borçlanma Araçları Devir Hızı : 0.08%
 Kamu Borçlanma Araçları Devir Hızı : 0.92%
 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: 830.069
 H. KATILMA PAYI İHRÇ. NAKİT GİRİŞLERİ:
 I. KATILMA PAYI İADE. NAKİT ÇIKIŞLARI: 7,603,682.47
 J. AYLIK KORELASYON:
 K. ÜÇ AYLIK KORELASYON:

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nom.Değ(TL)	Rayiç.Değ(TL)	%
A.PAY			
B.BORÇLANMA ARAÇLARI			
B.1.ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI			
TAHVİL			
TRSENSA32314	2,000,000.00	2,901,458.58	11.46%
TRSENSA32314	2,000,000.00	2,901,458.58	11.46%
TRSHEKT32123	500,000.00	504,881.45	1.99%
TRSOTKO32110	800,000.00	804,962.73	3.18%
TRSTHALE2716	750,000.00	754,763.67	2.98%
TRSTPRS22114	1,000,000.00	1,014,477.82	4.01%
Toplam	7,050,000.00	8,882,002.83	35.08%
BONO			
FINANSMAN BONOSU			
GOS(GELİR ORT.SEN)			
GES(GELİRE END.SEN)			
VDMK(VAR DAY MEN K)			
DIŞ BORÇLANMA ARACI			
XS1079527211	100,000.00	784,479.23	3.10%
XS1079527211	200,000.00	1,568,958.46	6.20%
XS1613091500	300,000.00	2,350,544.56	9.29%
XS1750996206	200,000.00	1,503,377.94	5.94%
XS1760780731	500,000.00	3,762,813.23	14.87%
Toplam	1,300,000.00	9,970,173.42	39.40%
Ara Grup Toplamı	8,350,000.00	18,852,176.25	74.47%
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			
US900123CW86	500,000.00	3,851,587.54	15.22%
Toplam	500,000.00	3,851,587.54	15.22%
Ara Grup Toplamı	500,000.00	3,851,587.54	15.21%
Ana Grup Toplamı	8,850,000.00	22,703,763.79	89.69%
C.KİRA SERTİFİKALARI			
KİRA SERTİFİKASI			
Ç.TÜREV ARAÇLAR			
TÜREV TEMİNAT			
VIOP-TL	1,221,157.74	1,367,121.74	5.40%
Toplam	1,221,157.74	1,367,121.74	5.40%
ALIM OPSİYONU			
Ç.1.VIOP OPSİYON			
VIOP ALIM OPSİYONU			
VIOP SATIM OPSİYONU			
Ana Grup Toplamı	1,221,157.74	1,367,121.74	5.40%

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

TRT030523T13

241,056.12

241,056.12

0.95%

TRT090621T18

1,000,328.77

1,000,328.77

3.95%

Toplam

1,241,384.89

1,241,384.89

4.90%

REPO

TAKASBANK BORSA PARA PİYASASI

MEVDUAT

YP MEVDUAT

YATIRIM FONU

GAYRİMENKUL SERTİFİKASI

Ana Grup Toplamı

1,241,384.89

1,241,384.89

4.90%

FON PORTFOY DEĞERİ

11,312,542.63

25,312,270.41

IV- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

	Tutarı (TL)	%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	25,312,270.41	100.00%
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	12,195.08	0.05%
C. ALACAKLAR (+) :	0	
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0	
E. BORÇLAR (-) :	13,437.45	0.05%
FON TOPLAM DEĞERİ:	25,311,028.04	

V- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı (TL)
370.01.000-Fon Yönetim Ücreti	6,177.66
370.02.000-Denetim Ücreti	687.9
370.03.000-Tahvil Borsa Payı	712.09
370.04.200-Brokerage Komisyonu	423.04
370.05.000-Vergi ve Resim Harç	58.8
370.06.000-Saklama Giderleri	2,488.31
370.09.000-Noter Masrafları	289.1
370.20.001-SPK Kayda Alma Mas	191.13
370.23.000-Futures İşlemi Kom	248.6
370.28.000-Portföy Saklama Gideri	1,971.28
370.33.000-Borsa Futures İşlemi Kom	143.37
TOPLAM	13,391.28

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_USDTRY1020-GRM	VIOP-02.09.2020	7.516	22	165,352.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-02.09.2020	7.516	2	15,032.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-02.09.2020	7.516	6	45,096.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-02.09.2020	7.516	10	75,160.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-02.09.2020	7.516	5	37,580.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-02.09.2020	7.516	1	7,516.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-02.09.2020	7.516	1	7,516.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-02.09.2020	7.516	3	22,548.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-02.09.2020	7.521	50	376,050.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-18.09.2020	7.6585	25	191,462.50	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-18.09.2020	7.6585	20	153,170.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-18.09.2020	7.6585	40	306,340.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-18.09.2020	7.659	50	382,950.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-18.09.2020	7.659	15	114,885.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-22.09.2020	7.7293	25	193,232.50	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-22.09.2020	7.7292	25	193,230.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-28.09.2020	7.7941	25	194,852.50	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-28.09.2020	7.7941	5	38,970.50	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-28.09.2020	7.7941	20	155,882.00	Uzun

Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-28.09.2020	7.7934	50	389,670.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-28.09.2020	7.7934	50	389,670.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-28.09.2020	7.7938	50	389,690.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-30.09.2020	7.8145	1	7,814.50	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-30.09.2020	7.8145	6	46,887.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-30.09.2020	7.8145	21	164,104.50	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-30.09.2020	7.8156	10	78,156.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-30.09.2020	7.8156	40	312,624.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-30.09.2020	7.8156	5	39,078.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-30.09.2020	7.8154	5	39,077.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-30.09.2020	7.8145	22	171,919.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1020-GRM	VIOP-30.09.2020	7.8156	10	78,156.00	Kısa
Forward Sözleşmesi	USD/TL	28.09.2020	7.742	1,563,884.00	202,000.00	USD Satış

XII- PAY ALIM SATIM DEFTERİ

Toplam Pay Adedi	10,000,000,000.00						Pay
Tarih	Pay Alışı	Pay Satışı	Alış Fiyatı	Satış Fiyatı	Dolaşımdaki Pay	Döviz Kodu	
01.09.2020	160,000.00		1.658417	1.658619	19,224,300.00	TL	
07.09.2020			1.666981	1.668643	19,224,300.00	TL	
08.09.2020			1.668643	1.671348	19,224,300.00	TL	
14.09.2020			1.678656	1.676526	19,224,300.00	TL	
15.09.2020			1.676526	1.679142	19,224,300.00	TL	
21.09.2020			1.680829	1.683131	15,444,300.00	TL	
22.09.2020	3,780,000.00		1.683131	1.678506	15,444,300.00	TL	
28.09.2020			1.692444	1.682932	14,864,300.00	TL	
29.09.2020	580,000.00		1.682932	1.695492	14,864,300.00	TL	