

YATIRIM FONLARI PORTFÖY DAĞILIM RAPORU

Rapor Dönemi 01/09/2018 ve 30/09/2018

I- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI:	GARANTİ PORTFÖY MUTLAK GETİRİ HEDEFLİ DEĞİŞKEN 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)	17,206,634.20
E. KATILMA PAYI SAYISI :	15,694,303
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ:	02.12.2018
G. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

II-FONUN PERFORMANS BİLGİLERİ

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI:	1.096362
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	1.078327
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	1.67%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYAT ARTIŞ ORANI:	
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
PAY	12.65%
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ	8.07%
ÖZEL SEKTÖR FINANSMAN BONOSU	9.65%
ÖZEL SEKTÖR DIŞ BORÇLANMA ARAÇI	7.85%
TÜREV TEMİNAT	3.19%
YABANCI HİSSE SENETLERİ	5.37%
TAKASBANK BORSA PARA PİYASASI	52.51%
MEVDUAT	0.71%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	0.17%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse :	0.75%
Özel Borçlanma Araçları Devir Hızı :	0.00%
Kamu Borçlanma Araçları Devir Hızı :	25.05%
Kira Sertifikaları Devir Hızı :	0.00%
Yabancı Menkul Kıymetler Devir Hızı :	1.04%
Altın Devir Hızı :	0.00%
Varant Devir Hızı :	0.00%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	638.714
H.KATILMA PAYI İHRÇ. NAKİT GİRİŞLERİ:	521,659.70
I.KATILMA PAYI İADE. NAKİT ÇIKIŞLARI:	3,871,068.95
J. AYLIK KORELASYON:	
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON:	

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nom.Değ(TL)	Rayiç.Değ(TL)	%
A.PAY			
ENJSA.E	200	1,058.00	0.01%
ENJSA.E	14,800.00	78,292.00	0.46%
AKBNK.E	16,200.00	112,104.00	0.66%
AKBNK.E	3,800.00	26,296.00	0.15%
AKBNK.E	17,750.00	122,830.00	0.72%
ASELS.E	325	8,963.50	0.05%
ASELS.E	3,150.00	86,877.00	0.51%
ASELS.E	2,025.00	55,849.50	0.33%
BIMAS.E	700	56,945.00	0.34%
BIMAS.E	1,300.00	105,755.00	0.62%
BIMAS.E	1,000.00	81,350.00	0.48%
EREGL.E	10,500.00	115,815.00	0.68%
EREGL.E	11,500.00	126,845.00	0.75%
GARAN.E	12,000.00	92,520.00	0.54%
GARAN.E	3,000.00	23,130.00	0.14%
GARAN.E	15,000.00	115,650.00	0.68%
ISCTR.E	5,000.00	22,100.00	0.13%
KCHOL.E	3,000.00	51,180.00	0.30%
KOZAL.E	1,000.00	51,350.00	0.30%
KOZAL.E	800	41,080.00	0.24%
KRDMD.E	10,000.00	40,600.00	0.24%
MAVI.E	1,500.00	53,790.00	0.32%
NTHOL.E	5,000.00	10,450.00	0.06%
NTHOL.E	5,000.00	10,450.00	0.06%
NTHOL.E	20,000.00	41,800.00	0.25%
SAHOL.E	3,000.00	22,890.00	0.13%
SAHOL.E	6,000.00	45,780.00	0.27%
SAHOL.E	6,000.00	45,780.00	0.27%
TCELL.E	4,400.00	50,776.00	0.30%
TCELL.E	3,600.00	41,544.00	0.24%
THYAO.E	6,000.00	114,540.00	0.67%
TRKCM.E	0.81	3.49	
TTKOM.E	15,000.00	54,600.00	0.32%
TUPRS.E	300	40,260.00	0.24%
TUPRS.E	1,500.00	201,300.00	1.18%
YKBNK.E	0.83	1.56	
Toplam	210,351.64	2,150,555.05	12.64%
Ana Grup Toplamı	210,351.64	2,150,555.05	12.65%
B.BORÇLANMA ARAÇLARI			
B.1.ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI			
TAHVİL			
TRSENSA32314	300,000.00	333,043.55	1.96%

TRSIGY32111	180,000.00	180,908.72	1.06%
TRSKCTF32014	350,000.00	310,265.70	1.83%
TRSOPAS22012	150,000.00	152,055.66	0.89%
TRSOPAS42010	370,000.00	395,255.17	2.33%
Toplam	1,350,000.00	1,371,528.80	8.07%
BONO			
FINANSMAN BONUSU			
TRFDSTFK1824	500,000.00	491,102.28	2.89%
TRFISFN41916	400,000.00	371,696.09	2.19%
TRFKPTLE1810	300,000.00	298,610.31	1.76%
TRFTPFCK1810	500,000.00	478,914.45	2.82%
Toplam	1,700,000.00	1,640,323.13	9.66%
GOS(GELIR ORT.SEN)			
GES(GELIRE END.SEN)			
VDMK(VAR DAY MEN K)			
DIŞ BORÇLANMA ARACI			
XS1390320981	250,000.00	1,334,105.90	7.85%
Toplam	250,000.00	1,334,105.90	7.85%
Ara Grup Toplamı	3,300,000.00	4,345,957.83	25.57%
B.2.KAMU SEKTÖRÜ BORÇLANMA ARAÇLARI			
TAHVİL			
BONO			
FINANSMAN BONUSU			
GOS(GELIR ORT.SEN)			
GES(GELIRE END.SEN)			
VDMK(VAR DAY MEN K)			
DIŞ BORÇLANMA ARACI			
Ana Grup Toplamı	3,300,000.00	4,345,957.83	25.57%
C.KİRA SERTİFİKALARI			
KİRA SERTİFİKASI			
Ç.TÜREV ARAÇLAR			
TÜREV TEMİNAT			
VIOP-TL	544,976.02	542,559.52	3.19%
Toplam	544,976.02	542,559.52	3.19%
ALIM OPSİYONU			
Ç.1.VIOP OPSİYON			
VIOP ALIM OPSİYONU			
VIOP SATIM OPSİYONU			
Ana Grup Toplamı	544,976.02	542,559.52	3.19%
D.YABANCI SERMAYE PİYASASI ARAÇLARI			
YABANCI TAHVİL			
İKRAZ İŞT. SER			
YABANCI KİRA SER			
YP HİSSE			
BORSA YATIRIM FONLARI			
CBU7LN	121	88,543.30	0.52%
CSPXLN	38	64,680.38	0.38%
EMCRLN	34	19,804.56	0.12%
EMCRLN	67	39,026.63	0.23%
EMUUSW	1,009.00	35,962.47	0.21%
EMUUSW	82	2,922.62	0.02%
EMUUSW	205	7,306.55	0.04%
IDBTLN	84	65,211.71	0.38%
IDBTLN	4	3,105.32	0.02%
IDTLN	1,107.00	29,283.16	0.17%
IDTLN	2,144.00	56,714.64	0.33%
IDTMLN	26	29,164.85	0.17%
IDTMLN	49	54,964.52	0.32%
IDTPLN	14	17,066.92	0.10%
IGLNLN	129	18,089.75	0.11%
IHYULN	31	19,277.12	0.11%
IJPALN	69	18,169.71	0.11%
IMBSLN	5,871.00	166,311.67	0.98%
IWDPSW	118	18,020.98	0.11%
LQDHLN	204	119,817.18	0.71%
LQDHLN	14	8,222.75	0.05%
LQDHLN	5	2,936.70	0.02%
SPMVLN	84	27,362.75	0.16%
Toplam	11,509.00	911,966.24	5.37%
YP VARANT			
Ana Grup Toplamı	11,509.00	911,966.24	5.36%
E.ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER			
KIYMETLİ MADEN			
F.VARANTLAR			
G.DİĞER VARLIKLAR			
TERS REPO			
REPO			
TAKASBANK BORSA PARA PİYASASI			
TBPP	1,076,438.36	1,053,038.58	6.20%
TBPP	1,627,150.68	1,592,873.11	9.37%
TBPP	1,091,232.88	1,049,503.91	6.18%
TBPP	3,294,246.58	3,146,567.43	18.52%
TBPP	1,099,673.97	1,044,180.13	6.14%
TBPP	1,101,024.66	1,037,129.42	6.10%
Toplam	9,289,767.13	8,923,292.58	52.51%
MEVDUAT			
VADELI	120,256.44	120,256.44	0.71%
Toplam	120,256.44	120,256.44	0.71%
YP MEVDUAT			
YATIRIM FONU			
GAYRİMENKUL SERTİFİKASI			

Ana Grup Toplamı	9,410,023.57	9,043,549.02	53.21%
FON PORTFOY DEĞERİ	13,476,860.23	16,994,587.63	

IV- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

	Tutarı (TL)	%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	16,994,587.63	98.77%
B. HAZİR DEĞERLER (+) :	27,413.67	0.16%
C. ALACAKLAR (+) :	431,762.79	2.51%
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0	
E. BORÇLAR (-) :	247,129.89	1.44%
FON TOPLAM DEĞERİ:	17,206,634.20	

V- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı (TL)
370.01.000-Fon Yönetim Ücreti	32,917.80
370.02.000-Denetim Ücreti	711.76
370.03.000-Tahvil Borsa Payı	65.33
370.04.000-Aracılık Komisyonu	423.66
370.04.200-Brokerage Komisyonu	39.16
370.05.000-Vergi ve Resim Harç	38.8
370.06.000-Saklama Giderleri	1,360.11
370.20.001-SPK Kayda Alma Mas	155.9
370.23.000-Futures İşlemi Kom	435.29
370.28.000-Portföy Saklama Gideri	1,145.25
370.33.000-Borsa Futures İşlemi Kom	294.58
370.99.000-Diger Giderler	169.63

TOPLAM

37,757.27

VI- GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

Açıklama	Nominal (TL)
ASELS Tem:% 2	7,000.00
TCELL Tem:% 29	12,000.00

VII- PORTFÖYDEN SATIŞLAR

Sermaye Piyasası Aracı	İhraççı Kurum	Satış Tarihi	Nominal (TL)	Satış Değ. (TL)
------------------------	---------------	--------------	--------------	-----------------

VIII- İTFALAR

Sermaye Piyasası Aracı	İtfa Tarihi	Nominal (TL)
TRDFDKT91817	06.09.18	300,000.00

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_XU0301018-GRM	VIOP-05.09.2018	117.875	20	235,750.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-05.09.2018	117.925	20	235,850.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-06.09.2018	118.45	30	355,350.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-07.09.2018	117.2	5	58,600.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-07.09.2018	117.225	5	58,612.50	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-07.09.2018	117.25	20	234,500.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-07.09.2018	6.5606	5	32,803.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-07.09.2018	6.5605	10	65,605.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-07.09.2018	6.5602	10	65,602.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-07.09.2018	6.56	25	164,000.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-13.09.2018	6.4849	57	369,639.30	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-13.09.2018	6.4847	33	213,995.10	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-13.09.2018	6.4834	35	226,919.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-13.09.2018	116.75	11	128,425.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-13.09.2018	116.725	28	326,830.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-13.09.2018	116.7	21	245,070.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-13.09.2018	119.025	15	178,537.50	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-13.09.2018	119.05	35	416,675.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-14.09.2018	120.85	20	241,700.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-17.09.2018	6.3616	8	50,892.80	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-17.09.2018	6.3619	2	12,723.80	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-17.09.2018	6.362	9	57,258.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-17.09.2018	6.3625	17	108,162.50	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-17.09.2018	6.3659	25	159,147.50	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-17.09.2018	6.3664	57	362,884.80	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-17.09.2018	6.3665	20	127,330.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-17.09.2018	6.3667	25	159,167.50	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-17.09.2018	6.3668	87	553,911.60	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-17.09.2018	6.3644	24	152,745.60	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-17.09.2018	6.365	15	95,475.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-17.09.2018	6.3652	11	70,017.20	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-20.09.2018	6.2343	9	56,108.70	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-20.09.2018	6.233	8	49,864.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-20.09.2018	6.2319	33	205,652.70	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-20.09.2018	6.2333	6	37,399.80	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-20.09.2018	6.2317	2	12,463.40	Kısa

Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-20.09.2018	6.2315	42	261,723.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-20.09.2018	123.375	20	246,750.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-20.09.2018	6.39	7	44,730.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-20.09.2018	6.3905	43	274,791.50	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-20.09.2018	6.3897	1	6,389.70	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-20.09.2018	6.39	4	25,560.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-21.09.2018	123.475	10	123,475.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-25.09.2018	126.85	10	126,850.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-26.09.2018	124.925	28	349,790.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-26.09.2018	124.9	2	24,980.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-27.09.2018	127.925	40	511,700.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-28.09.2018	126.875	17	215,687.50	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301018-GRM	VIOP-28.09.2018	126.9	3	38,070.00	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
03.09.2018	68,303.00		1.078064	1.078327	18,769,120.00	TL
04.09.2018	11,103.00		1.078327	1.082211	18,548,163.00	TL
05.09.2018	220,957.00	3,284.00	1.082211	1.083736	18,546,578.00	TL
06.09.2018	4,869.00	43,866.00	1.083736	1.085427	18,119,404.00	TL
07.09.2018	471,040.00	40,597.00	1.085427	1.086346	18,140,844.00	TL
10.09.2018	19,157.00	1,844.00	1.086346	1.084556	17,991,106.00	TL
11.09.2018	151,582.00	99,281.00	1.084556	1.08075	17,783,701.00	TL
12.09.2018	306,686.00		1.08075	1.081241	17,714,673.00	TL
13.09.2018	69,028.00	9,330.00	1.081241	1.082417	17,684,405.00	TL
14.09.2018	39,598.00		1.082417	1.089461	17,684,463.00	TL
17.09.2018		4,014.00	1.089461	1.083174	17,309,005.00	TL
18.09.2018	379,472.00	94,782.00	1.083174	1.08669	17,067,328.00	TL
19.09.2018	336,459.00	1,395.00	1.08669	1.089213	17,016,788.00	TL
20.09.2018	51,935.00	114,593.00	1.089213	1.090816	16,513,621.00	TL
21.09.2018	617,760.00	9,180.00	1.090816	1.089277	16,176,474.00	TL
24.09.2018	346,327.00	1,738.00	1.089277	1.092658	16,177,982.00	TL
25.09.2018		230	1.092658	1.09681	16,141,938.00	TL
26.09.2018	48,310.00	11,415.00	1.09681	1.094799	15,799,029.00	TL
27.09.2018	354,324.00	31,948.00	1.094799	1.095858	15,766,977.00	TL
28.09.2018	64,000.00		1.095858	1.097221	15,694,303.00	TL