

YATIRIM FONLARI PORTFÖY DAĞILIM RAPORU

Rapor Dönemi 01/02/2018 ve 28/02/2018

I- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI:	GARANTİ PORTFÖY EURO BOND 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)	20.739.063,94
E. KATILMA PAYI SAYISI :	15.844.808
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ:	01.08.2016
G. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

II-FONUN PERFORMANS BİLGİLERİ

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI:	1,308887
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	1,321057
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	-0,92%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	-1,57%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYAT ARTIŞ ORANI:	9,69%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
ÖZEL SEKTÖR DIŞ BORÇLANMA ARACI	24,18%
KAMU SEKTÖRÜ DIŞ BORÇLANMA ARACI	65,91%
TÜREV TEMİNAT	1,22%
TERS REPO	6,76%
MEVDUAT	1,93%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	0,16%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse :	0,00%
Özel Borçlanma Araçları Devir Hızı :	0,00%
Kamu Borçlanma Araçları Devir Hızı :	0,13%
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:	3698,753
H.KATILMA PAYI İHRÇ. NAKİT GİRİŞLERİ:	306.775,74
I.KATILMA PAYI İADE. NAKİT ÇIKIŞLARI:	3.112.616,71
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			
BONO			
FINANSMAN BONUSU			
GOS(GELİR ORT.SEN)			
GES(GELİRE END.SEN)			
VDMK(VAR DAY MEN K)			
DIŞ BORÇLANMA ARACI			
XS0874840688	200.000,00	754.829,40	3,62%
XS0874840688	200.000,00	754.829,40	3,62%
XS1508390090	200.000,00	772.029,13	3,70%
XS1508390090	200.000,00	772.029,13	3,70%
XS1584113184	500.000,00	1.993.444,21	9,55%
Toplam	1.300.000,00	5.047.161,27	24,19%
Ara Grup Toplamı	1.300.000,00	5.047.161,27	24,18%
B.2.KAMU SEKTÖRÜ BORÇLANMA ARAÇLARI			
TAHVİL			
BONO			
FINANSMAN BONUSU			
GOS(GELİR ORT.SEN)			
GES(GELİRE END.SEN)			
VDMK(VAR DAY MEN K)			
DIŞ BORÇLANMA ARACI			
US900123AL40	40.000,00	231.916,06	1,11%
US900123AY60	25.000,00	103.258,94	0,49%
US900123AY60	100.000,00	413.035,75	1,98%
US900123AY60	200.000,00	826.071,50	3,96%
US900123BB58	5.000,00	21.574,51	0,10%
US900123BD15	8.000,00	32.472,15	0,16%
US900123BF62	9.000,00	37.105,78	0,18%
US900123BG46	50.000,00	201.005,08	0,96%
US900123BG46	50.000,00	201.005,08	0,96%
US900123BG46	100.000,00	402.010,16	1,93%
US900123BH29	4.000,00	16.170,54	0,08%
US900123BH29	200.000,00	808.526,76	3,87%
US900123BJ84	60.000,00	219.155,22	1,05%
US900123BY51	100.000,00	397.790,97	1,91%
US900123BZ27	74.000,00	307.615,26	1,47%
US900123BZ27	97.000,00	403.225,41	1,93%
US900123CA66	125.000,00	450.023,64	2,16%
US900123CF53	150.000,00	605.527,03	2,90%
US900123CG37	200.000,00	771.585,32	3,70%
US900123CJ75	30.000,00	107.213,55	0,51%
US900123CJ75	30.000,00	107.213,55	0,51%
US900123CJ75	26.000,00	92.918,41	0,45%
US900123CJ75	134.000,00	478.887,19	2,29%
US900123CJ75	200.000,00	714.757,01	3,42%
US900123CK49	200.000,00	741.004,58	3,55%
US900123CK49	400.000,00	1.482.009,15	7,10%
US900123CL22	200.000,00	798.936,32	3,83%
US900123CM05	300.000,00	1.050.358,67	5,03%
US900123CM05	200.000,00	700.239,11	3,36%
XS0503454166	100.000,00	522.268,32	2,50%
XS0993155398	100.000,00	510.002,85	2,44%
Toplam	3.517.000,00	13.754.883,87	65,89%
Ara Grup Toplamı	3.517.000,00	13.754.883,87	65,90%
Ana Grup Toplamı	4.817.000,00	18.802.045,14	90,09%
C.KİRA SERTİFİKALARI			
KİRA SERTİFİKASI			
Ç.TÜREV ARAÇLAR			
TÜREV TEMİNAT			
VIOP-TL	254.615,72	254.615,72	1,22%
Toplam	254.615,72	254.615,72	1,22%
ALIM OPSİYONU			
Ç.1.VIOP OPSİYON			

VIOP ALIM OPSİYONU				
VIOP SATIM OPSİYONU				
Ana Grup Toplamı	254.615,72	254.615,72	1,22%	
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				
TRT111120T18	1.000.333,15	1.000.333,15	4,79%	
TRT170221T12	145.040,96	145.040,96	0,69%	
TRT170221T12	265.074,85	265.074,85	1,27%	
Toplam	1.410.448,96	1.410.448,96	6,75%	
REPO				
TAKASBANK BORSA PARA PİYASASI				
MEVDUAT				
VADELİ	405.514,52	402.423,57	1,93%	
Toplam	405.514,52	402.423,57	1,93%	
YP MEVDUAT				
YATIRIM FONU				
GAYRİMENKUL SERTİFİKASI				
Ana Grup Toplamı	1.815.963,48	1.812.872,53	8,68%	
FON PORTFOY DEĞERİ	6.887.579,20	20.869.533,40		

IV- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

Tutarı (TL)		%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	20.869.533,40	100,63%
B. HAZİR DEĞERLER (+) :	8.380,09	0,04%
C. ALACAKLAR (+) :	0,01	
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0	
E. BORÇLAR (-) :	138.849,56	0,67%

FON TOPLAM DEĞERİ:

20.739.063,94

V- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı (TL)
370.01.000-Fon Yönetim Ücreti	20.689,37
370.02.000-Denetim Ücreti	113,76
370.03.000-Tahvil Borsa Payı	32,86
370.04.200-Brokerage Komisyonu	18,78
370.05.000-Vergi ve Resim Harç	99,4
370.06.000-Saklama Giderleri	1.069,55
370.07.000-İlan Giderleri	2.902,80
370.09.000-Noter Masrafları	243,55
370.20.001-SPK Kayda Alma Mas	296,07
370.23.000-Futures İşlemi Kom	98,48
370.28.000-Portföy Saklama Gideri	1.325,91
370.33.000-Borsa Futures İşlemi Kom	56,79
370.99.000-Diger Giderler	1.392,29
TOPLAM	28.339,61

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)
Kamu Dış Borçlanma Aracı YP/USD	US900123CB4020180222	22.02.2018	260.000,00	218.806,25
Kamu Dış Borçlanma Aracı YP/USD	US900123CL2220180227	27.02.2018	300.000,00	315.700,00
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	01.02.18	170.000,00	170.059,38
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	02.02.18	285.000,00	285.298,66
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	05.02.18	280.000,00	280.097,81
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	06.02.18	15.000,00	15.005,24
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	08.02.18	80.000,00	80.027,95
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	09.02.18	90.000,00	90.094,32
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	12.02.18	96.000,00	96.033,53
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	13.02.18	90.000,00	90.031,44
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	14.02.18	400.000,00	405.514,52
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	14.02.18	90.000,00	90.031,44
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	15.02.18	30.000,00	30.010,48
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	16.02.18	70.000,00	70.073,36
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	19.02.18	90.000,00	90.031,44
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	20.02.18	175.000,00	175.061,13
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	21.02.18	180.000,00	180.062,88
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	22.02.18	535.000,00	535.186,88
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	23.02.18	500.000,00	500.523,97
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	27.02.18	540.000,00	540.188,63

VIII- İTFALAR

Sermaye Piyasası Aracı İfta Tarihi Nominal (TL)

IX- PORTFÖYE ALIŞLAR

Sermaye Piyasası Aracı	İhraççı Kurum	Alış Tarihi-G.D.Tarihi	Nominal (TL)	Alış Değ. (TL)
TL Ters Repo	TRT270319T13	01.02.18-02.02.18	510.525,00	500.000,00

TL Ters Repo	TRT111120T18	22.02.18-23.02.18	509.890,00	500.000,00
TL Ters Repo	TRT111120T18	23.02.18-26.02.18	509.175,00	500.000,00
TL Ters Repo	TRT160425T17	26.02.18-27.02.18	295.315,00	345.000,00
TL Ters Repo	TRT170221T12	26.02.18-27.02.18	542.410,00	500.000,00
TL Ters Repo	TRT120128T11	27.02.18-28.02.18	1.591.300,00	1.500.000,00
TL Ters Repo	TRT111120T18	28.02.18-01.03.18	1.005.385,00	1.000.000,00
TL Ters Repo	TRT170221T12	28.02.18-01.03.18	156.585,00	145.000,00
TL Ters Repo	TRT170221T12	28.02.18-01.03.18	286.170,00	265.000,00
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	14.02.18	509.336,99	523.095,37
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	01.02.18	445.000,00	445.155,45
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	02.02.18	170.000,00	170.059,38
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	05.02.18	285.000,00	285.298,66
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	06.02.18	280.000,00	280.097,81
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	07.02.18	15.000,00	15.005,24
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	09.02.18	80.000,00	80.027,95
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	12.02.18	90.000,00	90.094,32
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	13.02.18	96.000,00	96.033,53
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	14.02.18	90.000,00	90.031,44
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	15.02.18	90.000,00	90.031,44
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	16.02.18	30.000,00	30.010,48
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	19.02.18	70.000,00	70.073,36
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	20.02.18	90.000,00	90.031,44
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	21.02.18	175.000,00	175.061,13
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	22.02.18	180.000,00	180.062,88
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	23.02.18	535.000,00	535.186,88
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	26.02.18	500.000,00	500.523,97
Vadeli TL Mevduat/Depo	GB	28.02.18	540.000,00	540.188,63

X- ÖDÜNÇ İŞLEMLERİ
Sermaye Piyasası Aracı

Menkul Kıymet

İşlem-Vade Tarihi Nominal Cari Piyasa Değeri

XI- TÜREV ARAÇ İŞLEMLERİ
FUTURES SÖZLEŞMELERİ

Sermaye Piyasası Aracı

Futures Sözleşmesi-VIOP
Futures Sözleşmesi-VIOP
Futures Sözleşmesi-VIOP
Futures Sözleşmesi-VIOP
Futures Sözleşmesi-VIOP
Futures Sözleşmesi-VIOP
Futures Sözleşmesi-VIOP
Futures Sözleşmesi-VIOP
Futures Sözleşmesi-VIOP
Forward Sözleşmesi

ISIN
F_USDTRY0218-GRM
F_USDTRY0218-GRM
F_USDTRY0218-GRM
F_USDTRY0218-GRM
F_USDTRY0218-GRM
F_USDTRY0218-GRM
F_USDTRY0218-GRM
F_USDTRY0218-GRM
F_USDTRY0218-GRM
USD/TL

İşlem Tarihi Fiyat Nominal Cari Piyasa Değeri Kısa/Uzun
VIOP-20.02.2018 3,7883 4 15.153,20 Uzun
VIOP-20.02.2018 3,7883 46 174.261,80 Uzun
VIOP-20.02.2018 3,7883 50 189.415,00 Uzun
VIOP-20.02.2018 3,7881 50 189.405,00 Uzun
VIOP-20.02.2018 3,7881 1 3.788,10 Uzun
VIOP-20.02.2018 3,7879 39 147.728,10 Uzun
VIOP-20.02.2018 3,7883 210 795.543,00 Uzun
VIOP-20.02.2018 3,7883 100 378.830,00 Uzun
21.02.2018 3,7875 757.500,00 200.000,00 USD Satış

XII- PAY ALIM SATIM DEFTERİ

Toplam Pay Adedi 10.000.000.000,00

Tarih	Pay Alışı	Pay Satışı			Dolaşımdaki Pay	Pay Döviz Kodu
		Pay Satışı	Alış Fiyatı	Satış Fiyatı		
01.02.2018		201.178,00	13.704,00	1,323255	1,321057	16.874.773,00 TL
02.02.2018		996.796,00	1.778,00	1,325738	1,321897	16.650.216,00 TL
05.02.2018		4.489,00	4.076,00	1,321057	1,315206	16.645.836,00 TL
06.02.2018		226.335,00	21.320,00	1,321897	1,313074	16.660.681,00 TL
07.02.2018		8.456,00	1.053,00	1,315206	1,315227	16.653.666,00 TL
08.02.2018		6.475,00	63.608,00	1,313074	1,31642	16.709.899,00 TL
09.02.2018		8.068,00	13.261,00	1,315227	1,319441	16.719.521,00 TL
12.02.2018		7.375,00	12.405,00	1,31642	1,313691	16.630.608,00 TL
13.02.2018		3.639,00	2.292,00	1,319441	1,30864	16.590.673,00 TL
14.02.2018		101.318,00	7.644,00	1,313691	1,308125	16.592.731,00 TL
15.02.2018		42.227,00	499	1,30864	1,302157	16.593.230,00 TL
16.02.2018		5.586,00	33.845,00	1,308125	1,292591	16.515.848,00 TL
19.02.2018			15.521,00	1,302157	1,296978	16.528.540,00 TL
20.02.2018		111.227,00	22.365,00	1,292591	1,301005	16.550.905,00 TL
21.02.2018		2.829,00	11.520,00	1,296978	1,302016	16.535.229,00 TL
22.02.2018				1,301005	1,306343	16.414.305,00 TL
23.02.2018		27.196,00	1.542,00	1,302016	1,306296	16.412.949,00 TL
26.02.2018		120.924,00		1,306343	1,303107	15.925.822,00 TL
27.02.2018		2.898,00	3.912,00	1,306296	1,303512	15.865.746,00 TL
28.02.2018		487.127,00	4.066,00	1,303107	1,307539	15.844.808,00 TL