

YATIRIM FONLARI PORTFÖY DAĞILIM RAPORU

Rapor Dönemi 01/08/2018 ve 31/08/2018

I- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI: GARANTİ PORTFÖY İKİNCİ SERBEST (DÖVİZ) 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) 21,023,206.38
 E. KATILMA PAYI SAYISI : 3,499,661
 F. FONUN KURULUŞ TARİHİ: 16/07/2018
 G. FONUN SÜRESİ: SÜRESİZ

II-FONUN PERFORMANS BİLGİLERİ

	TL	USD
A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI:	6.007212	0.91716
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	4.840128	0.987801
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	24.11%	-7.15%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:		
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYAT ARTIŞ ORANI:		
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:		
ÖZEL SEKTÖR DIŞ BORÇLANMA ARACI	32.58%	
KAMU SEKTÖRÜ DIŞ BORÇLANMA ARACI	54.41%	
TÜREV TEMİNAT	2.58%	
YP MEVDUAT	10.42%	
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	0.03%	
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:		
Hisse :	0.00%	
Özel Borçlanma Araçları Devir Hızı :	0.00%	
Kamu Borçlanma Araçları Devir Hızı :	0.79%	
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:	1789.357	
H. KATILMA PAYI İHRÇ. NAKİT GİRİŞLERİ:	6,329,429.57	
I. KATILMA PAYI İADE. NAKİT ÇIKIŞLARI:	4,840.40	
J. AYLIK KORELASYON:		
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON:		

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nom.Değ(TL)	Rayıç.Değ(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			
XS1508914691	800,000.00	4,214,597.19	20.05%
XS1508914691	500,000.00	2,634,123.24	12.53%
Toplam	1,300,000.00	6,848,720.43	32.58%
Ara Grup Toplamı	1,300,000.00	6,848,720.43	32.58%
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			
US900123BZ27	1,000,000.00	6,134,365.84	29.18%
US900123CK49	1,000,000.00	5,302,816.33	25.23%
Toplam	2,000,000.00	11,437,182.17	54.41%
Ara Grup Toplamı	2,000,000.00	11,437,182.17	54.40%
Ana Grup Toplamı	3,300,000.00	18,285,902.60	86.99%
C.KİRA SERTİFİKALARI			
KİRA SERTİFİKASI			
Ç.TÜREV ARAÇLAR			
TÜREV TEMİNAT			
VIOP-TL	520,914.53	543,234.53	2.58%
Toplam	520,914.53	543,234.53	2.58%
ALIM OPSİYONU			
Ç.1.VIOP OPSİYON			
VIOP ALIM OPSİYONU			
VIOP SATIM OPSİYONU			
Ana Grup Toplamı	520,914.53	543,234.53	2.58%
Ana Grup Toplamı	520,914.53	543,234.53	2.58%
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			

REPO			
TAKASBANK BORSA PARA PIYASASI			
MEVDUAT			
YP MEVDUAT			
VADELI	334,568.73	2,191,358.27	10.42%
Toplam	334,568.73	2,191,358.27	10.42%
YATIRIM FONU			
GAYRİMENKUL SERTİFİKASI			
Ana Grup Toplamı	334,568.73	2,191,358.27	10.42%
FON PORTFOY DEĞERİ	4,155,483.26	21,020,495.40	

IV- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

	Tutarı (TL)	%	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	21,020,495.40	99.99%	
B. HAZİR DEĞERLER (+) :	20,799.00	0.10%	
C. ALACAKLAR (+) :	0		
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0		
E. BORÇLAR (-) :	18,088.02	0.09%	
FON TOPLAM DEĞERİ:	21,023,206.38		

V- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı (TL)
370.01.000-Fon Yönetim Ücreti	13,693.87
370.02.000-Denetim Ücreti	1,049.40
370.05.000-Vergi ve Resim Harç	99.4
370.06.000-Saklama Giderleri	754.89
370.20.001-SPK Kayda Alma Mas	462.43
370.23.000-Futures İşlemi Kom	489.91
370.28.000-Portföy Saklama Gideri	1,095.40
370.33.000-Borsa Futures İşlemi Kom	282.50
TOPLAM	17,927.80

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 İtf 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_USDTRY0818-GRM	VIOP-01.08.2018	4.9891	50	249,455.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-01.08.2018	4.9897	49	244,495.30	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-01.08.2018	4.9898	1	4,989.80	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-01.08.2018	4.989	3	14,967.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-01.08.2018	4.9891	2	9,978.20	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-01.08.2018	4.9896	25	124,740.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-01.08.2018	4.9897	20	99,794.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-02.08.2018	5.1185	49	250,806.50	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-02.08.2018	5.1186	1	5,118.60	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-02.08.2018	5.1183	25	127,957.50	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-02.08.2018	5.1188	1	5,118.80	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-02.08.2018	5.119	17	87,023.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-02.08.2018	5.1191	7	35,833.70	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-02.08.2018	5.1182	1	5,118.20	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-02.08.2018	5.1183	1	5,118.30	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-02.08.2018	5.119	4	20,476.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-02.08.2018	5.1191	18	92,143.80	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-02.08.2018	5.1192	1	5,119.20	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-02.08.2018	5.1193	5	25,596.50	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-02.08.2018	5.1195	20	102,390.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-06.08.2018	5.178	41	212,298.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-06.08.2018	5.1785	1	5,178.50	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-06.08.2018	5.1787	25	129,467.50	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-06.08.2018	5.179	1	5,179.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-06.08.2018	5.1791	4	20,716.40	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-06.08.2018	5.1792	24	124,300.80	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-06.08.2018	5.1793	104	538,647.20	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-07.08.2018	5.3119	25	132,797.50	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-07.08.2018	5.3118	10	53,118.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-07.08.2018	5.3114	5	26,557.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-07.08.2018	5.3113	5	26,556.50	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-07.08.2018	5.3112	10	53,112.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-07.08.2018	5.3111	13	69,044.30	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-07.08.2018	5.3108	1	5,310.80	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-07.08.2018	5.3107	14	74,349.80	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-07.08.2018	5.3106	25	132,765.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-07.08.2018	5.3105	25	132,762.50	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-07.08.2018	5.31	50	265,500.00	Kısa

Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-07.08.2018	5.3099	17	90,268.30	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-07.08.2018	5.3088	10	53,088.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-07.08.2018	5.3084	190	1,008,596.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-09.08.2018	5.462	200	1,092,400.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-10.08.2018	5.98	200	1,196,000.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-10.08.2018	5.9786	2	11,957.20	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-10.08.2018	5.9783	3	17,934.90	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-10.08.2018	5.9781	1	5,978.10	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-10.08.2018	5.978	10	59,780.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-10.08.2018	5.9773	2	11,954.60	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-10.08.2018	5.9772	182	1,087,850.40	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-27.08.2018	6.1901	25	154,752.50	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-27.08.2018	6.19	8	49,520.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-27.08.2018	6.189	5	30,945.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-27.08.2018	6.1882	1	6,188.20	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-27.08.2018	6.188	2	12,376.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-27.08.2018	6.1877	2	12,375.40	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-27.08.2018	6.1876	21	129,939.60	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0818-GRM	VIOP-27.08.2018	6.1875	36	222,750.00	Kısa
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-27.08.2018	6.4859	50	324,295.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-27.08.2018	6.484	22	142,648.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-27.08.2018	6.485	5	32,425.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1018-GRM	VIOP-27.08.2018	6.486	23	149,178.00	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
01.08.2018			4.840419	4.840128		TL
01.08.2018		1,000.00	0.990874	0.987801	2,316,082.00	USD
02.08.2018			4.840128	4.837021		TL
02.08.2018			0.987801	0.982675	2,316,082.00	USD
03.08.2018			4.837021	4.933417		TL
03.08.2018			0.982675	0.976837	2,316,082.00	USD
06.08.2018			4.933417	4.97561		TL
06.08.2018			0.976837	0.979875	2,316,082.00	USD
07.08.2018			4.97561	5.05507		TL
07.08.2018			0.979875	0.982254	2,316,082.00	USD
08.08.2018			5.05507	5.162434		TL
08.08.2018		101,955.00	0.982254	0.980817	2,418,037.00	USD
09.08.2018			5.162434	5.162358		TL
09.08.2018			0.980817	0.977479	2,418,037.00	USD
10.08.2018			5.162358	5.2565		TL
10.08.2018			0.977479	0.973642	2,418,037.00	USD
13.08.2018			5.2565	5.677119		TL
13.08.2018			0.973642	0.955921	2,418,037.00	USD
14.08.2018			5.677119	6.205243		TL
14.08.2018			0.955921	0.901951	2,418,037.00	USD
15.08.2018			6.205243	5.96422		TL
15.08.2018			0.901951	0.911055	2,418,037.00	USD
16.08.2018			5.96422	5.582922		TL
16.08.2018			0.911055	0.909863	2,418,037.00	USD
17.08.2018			5.582922	5.360641		TL
17.08.2018		1,081,624.00	0.909863	0.924535	3,499,661.00	USD
20.08.2018			5.360641	5.521152		TL
20.08.2018			0.924535	0.921052	3,499,661.00	USD
27.08.2018			5.521152	5.526667		TL
27.08.2018			0.921052	0.921972	3,499,661.00	USD