

YATIRIM FONLARI PORTFÖY DAĞILIM RAPORU

01/01/2020 ve 31/01/2020

I- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI:

B. KURUCUNUN ÜNVANI:

C. YÖNETİCİNİN ÜNVANI:

Ç. FON TUTARI: (TL)

D. TOPLAM DEĞER: (TL)

E. KATILMA PAYI SAYISI :

F. FONUN KURULUŞ TARİHİ:

G. FONUN SÜRESİ:

28/04/2013

SÜRESİZ

GARANTİ PORTFÖY YABANCI BYF FON SEPETİ FONU

GARANTİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.

GARANTİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.

500,000,000.00

21,207,948.74

827,349,937.00

II-FONUN PERFORMANS BİLGİLERİ

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI:

B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:

C.AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:

Ç.YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:

D.YILLIK KATILMA PAYI FİYAT ARTIŞ ORANI:

E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:

TÜREV TEMİNAT

YABANCI HİSSE SENETLERİ

TERS REPO

YP MEVDUAT

F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:

G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:

Hisse :

Özel Borçlanma Araçları Devir Hızı :

Kamu Borçlanma Araçları Devir Hızı :

Kira Sertifikaları Devir Hızı :

Yabancı Menkul Kıymetler Devir Hızı :

Altın Devir Hızı :

Varant Devir Hızı :

Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:

H.KATILMA PAYI İHRÇ. NAKİT GİRİŞLERİ:

I.KATILMA PAYI İADE. NAKİT ÇIKIŞLARI:

J. AYLIK KORELASYON:

K. ÜÇ AYLIK KORELASYON:

0.025634

0.025724

-0.35%

-0.35%

16.34%

1.90%

93.00%

2.54%

2.55%

1.46%

0.00%

0.00%

0.00%

0.00%

2.08%

0.00%

0.00%

3

4,652,378.82

2,069,545.08

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

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

C.KİRA SERTİFİKALARI

KİRA SERTİFİKASI

Ç.TÜREV ARAÇLAR

TÜREV TEMİNAT

VIOP-TL

Toplam

ALIM OPSİYONU

Ç.1.VIOP OPSİYON

VIOP ALIM OPSİYONU

VIOP SATIM OPSİYONU

Ana Grup Toplamı

D.YABANCI SERMAYE PİYASASI ARAÇLARI

YABANCI TAHVİL

İKRAZ İŞT. SER

YABANCI KİRA SER

YP HİSSE

BORSA YATIRIM FONLARI

CBU7LN

CBU7LN

CBU7LN

CSPXLN

CSPXLN

EIMILN

EIMILN

EIMILN

EMCRLN

EMCRLN

EMCRLN

EMUULN

EMUULN

IDBTLN

IDBTLN

IDBTLN

IDTMLN

IDTMLN

IDTPLN

IDTPLN

3,200.00

600

300

200

30

3,000.00

1,500.00

800

1,300.00

300

100

20,000.00

3,500.00

2,400.00

600

500

700

150

650

150

2,578,251.97

483,422.24

241,711.12

384,946.02

57,741.90

509,223.88

254,611.94

135,793.03

807,806.10

186,416.79

62,138.93

801,164.56

140,203.80

1,913,477.70

478,369.42

398,641.19

874,125.85

187,312.68

872,522.20

201,351.28

12.25%

2.30%

1.15%

1.83%

0.27%

2.42%

1.21%

0.65%

3.84%

0.89%

0.30%

3.81%

0.67%

9.09%

2.27%

1.89%

4.15%

0.89%

4.15%

0.96%

IEMBLN	1,250.00	858,411.94	4.08%
IEMBLN	500	343,364.77	1.63%
IEMBLN	1,250.00	858,411.94	4.08%
IGLNLN	3,000.00	556,347.69	2.64%
IGLNLN	500	92,724.62	0.44%
IHYULN	1,400.00	860,579.99	4.09%
IHYULN	250	153,675.00	0.73%
IMBSLN	59,000.00	1,733,373.94	8.23%
IMBSLN	10,000.00	293,792.19	1.40%
LQDHLN	2,850.00	1,687,381.94	8.02%
SPMVLN	1,000.00	379,439.28	1.80%
SPMVLN	500	189,719.64	0.90%
Toplam	121,480.00	19,576,455.54	93.03%
YP VARANT			
Ana Grup Toplamı	121,480.00	19,576,455.54	93.00%
E.ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER			
KIYMETLİ MADEN			
F.VARANTLAR			
G.DİĞER VARLIKLAR			
TERS REPO			
TRT071020T23	35,026.21	35,026.21	0.17%
TRT240227T17	500,442.60	500,442.60	2.38%
Toplam	535,468.81	535,468.81	2.55%
REPO			
TAKASBANK BORSA PARA PIYASASI			
MEVDUAT			
YP MEVDUAT			
VADELI	90,158.61	537,622.04	2.55%
Toplam	90,158.61	537,622.04	2.55%
YATIRIM FONU			
GAYRİMENKUL SERTİFİKASI			
Ana Grup Toplamı	625,627.42	1,073,090.85	5.09%
FON PORTFOY DEĞERİ	1,147,977.11	21,049,203.58	

IV- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

	Tutarı (TL)	%	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:			
B. HAZİR DEĞERLER (+) :	21,049,203.58	99.25%	
C. ALACAKLAR (+) :	6,160.00	0.03%	
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	1,554,765.59	7.33%	
E. BORÇLAR (-) :	0		
	1,402,180.43	6.61%	

FON TOPLAM DEĞERİ: 21,207,948.74

V- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı (TL)
370.01.000-Fon Yönetim Ücreti	34,767.38
370.02.000-Denetim Ücreti	549.76
370.03.000-Tahvil Borsa Payı	391.77
370.04.000-Aracılık Komisyonu	91,008.44
370.04.200-Brokerage Komisyonu	223.89
370.05.000-Vergi ve Resim Harç	1,253.61
370.06.000-Saklama Giderleri	2,174.99
370.15.001-BPP Kom	98.91
370.20.001-SPK Kayda Alma Mas	384.59
370.23.000-Futures İşlemi Kom	39.07
370.27.000-BPP İşlem Masrafı	11.92
370.28.000-Portföy Saklama Gideri	1,359.30
370.33.000-Borsa Futures İşlemi Kom	22.54
370.99.000-Diger Giderler	3.77

TOPLAM 132,289.94

VI- GEÇEN AY İÇİNDE

RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI
BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI
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 İfta 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_USDTRY0220-GRM	VIOP-30.01.2020	6.0174	7	42,121.80	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0220-GRM	VIOP-30.01.2020	6.0174	4	24,069.60	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0220-GRM	VIOP-30.01.2020	6.0174	6	36,104.40	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0220-GRM	VIOP-30.01.2020	6.0174	1	6,017.40	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0220-GRM	VIOP-30.01.2020	6.0174	16	96,278.40	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0220-GRM	VIOP-30.01.2020	6.0174	1	6,017.40	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0220-GRM	VIOP-30.01.2020	6.0174	1	6,017.40	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0220-GRM	VIOP-30.01.2020	6.0174	1	6,017.40	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0220-GRM	VIOP-30.01.2020	6.0174	3	18,052.20	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0220-GRM	VIOP-30.01.2020	6.0174	1	6,017.40	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY0220-GRM	VIOP-30.01.2020	6.0174	84	505,461.60	Uzun
Forward Sözleşmesi	USD/TL	24.01.2020	5.947	200,000.00	1,189,400.00	USD Alış
Forward Sözleşmesi	USD/TL	27.01.2020	5.9525	450,000.00	2,678,625.00	USD Alış

Forward Sözleşmesi	USD/TL	29.01.2020	5.9605	140,000.00	834,470.00 USD Alış
XII- PAY ALIM SATIM DEFTERİ					
Toplam Pay Adedi		50,000,000,000.00			
Tarih	Pay Alışı	Pay Satışı	Alış Fiyatı	Satış Fiyatı	Dolaşımdaki Pay Pay Döviz Kodu
02.01.2020		3,094,896.00	2,118,326.00	0.025757	0.025724 739,121,761.00 TL
03.01.2020		1,159,576.00		0.025683	0.026117 731,160,436.00 TL
06.01.2020		2,656,353.00		0.025724	0.025865 730,855,742.00 TL
07.01.2020		7,961,325.00		0.026117	0.025765 721,571,356.00 TL
08.01.2020		304,694.00		0.025865	0.025765 721,352,527.00 TL
09.01.2020		9,284,386.00		0.025765	0.025824 720,321,863.00 TL
10.01.2020		218,829.00		0.025765	0.025679 719,931,316.00 TL
13.01.2020		1,030,664.00		0.025824	0.02575 719,067,659.00 TL
14.01.2020		390,547.00		0.025679	0.025974 714,011,601.00 TL
15.01.2020		863,657.00		0.02575	0.025995 711,160,973.00 TL
16.01.2020		5,056,058.00		0.025974	0.02588 706,964,191.00 TL
17.01.2020		2,850,628.00		0.025995	0.025944 706,078,972.00 TL
20.01.2020		4,196,782.00		0.02588	0.026017 691,865,423.00 TL
21.01.2020		885,219.00		0.025944	0.026174 689,845,592.00 TL
22.01.2020		14,213,549.00		0.026017	0.025787 672,424,670.00 TL
23.01.2020		2,019,831.00		0.026174	0.025961 671,706,034.00 TL
24.01.2020		17,420,922.00		0.025787	0.025433 671,353,327.00 TL
27.01.2020		718,636.00	51,923,841.00	0.025961	0.02551 721,197,117.00 TL
28.01.2020		352,707.00	90,596,424.00	0.025433	0.025453 810,539,176.00 TL
29.01.2020		2,080,051.00	31,089,494.00	0.02551	0.025488 839,641,156.00 TL
30.01.2020		1,254,365.00	4,968,295.00	0.025453	0.025552 844,428,021.00 TL
31.01.2020		1,987,514.00	1,872,372.00	0.025488	0.025636 827,349,937.00 TL