

YATIRIM FONLARI PORTFÖY DAĞILIM RAPORU

Rapor Dönemi 01/12/2020 ve 31/12/2020

I- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI: GARANTİ PORTFÖY ÜÇÜNCÜ 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) 87,093,846.68
E. KATILMA PAYI SAYISI : 35,723,180.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ: 28/04/2015
G. FONUN SÜRESİ: SÜRESİZ

II-FONUN PERFORMANS BİLGİLERİ

TL
A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI: 2.438021
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI: 2.361603
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI: 3.24%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI: 18.86%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYAT ARTIŞ ORANI: 18.86%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:
PAY 21.70%
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLİ 12.91%
DEVLET TAHVİLİ 5.29%
KAMU SEKTÖRÜ DIŞ BORÇLANMA ARACI 13.36%
TÜREV TEMİNAT 3.49%
YABANCI HİSSE SENETLERİ 6.23%
ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER 2.14%
TERS REPO 33.08%
MEVDUAT 1.79%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI: 0.37%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:
Hisse : 0.76%
Özel Borçlanma Araçları Devir Hızı : 0.00%
Kamu Borçlanma Araçları Devir Hızı : 0.34%
Kira Sertifikaları Devir Hızı : 0.00%
Yabancı Menkul Kıymetler Devir Hızı : 0.30%
Altın Devir Hızı : 0.00%
Varant Devir Hızı : 0.00%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ: 697.459
H. KATILMA PAYI İHRÇ. NAKİT GİRİŞLERİ: 8,369,942.47
I. KATILMA PAYI İADE. NAKİT ÇIKIŞLARI: 16,993,704.83
J. AYLIK KORELASYON:
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON:

III-FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nom.Değ(TL)	Rayiç.Değ(TL)	%
A.PAY			
AEFES.E	6,919.00	160,382.42	0.19%
AKBNK.E	34,051.00	235,973.43	0.28%
AKBNK.E	50,000.00	346,500.00	0.41%
AKBNK.E	67,046.00	464,628.78	0.55%
AKBNK.E	50,000.00	346,500.00	0.41%
ARCLK.E	2,941.00	89,406.40	0.11%
ARCLK.E	6,000.00	182,400.00	0.22%
ARCLK.E	8,182.00	248,732.80	0.30%
ARDYZ.E	3,460.00	166,356.80	0.20%
ASELS.E	1,112.00	20,294.00	0.02%
ASELS.E	2,946.00	53,764.50	0.06%
ASELS.E	4,325.00	78,931.25	0.09%
ASELS.E	20,000.00	365,000.00	0.44%
BIMAS.E	1,359.00	102,604.50	0.12%
BIMAS.E	4,170.00	314,835.00	0.38%
BIMAS.E	5,729.00	432,539.50	0.52%
BIMAS.E	5,414.00	408,757.00	0.49%
BIMAS.E	5,000.00	377,500.00	0.45%
DOHOL.E	36,468.00	111,956.76	0.13%
DOHOL.E	40,000.00	122,800.00	0.15%
DOHOL.E	26,211.00	80,467.77	0.10%
EKGYO.E	138,412.00	296,201.68	0.35%
EREGL.E	23,437.00	349,914.41	0.42%
EREGL.E	23,373.00	348,958.89	0.42%
EREGL.E	32,111.00	479,417.23	0.57%
EREGL.E	20,000.00	298,600.00	0.36%
EREGL.E	20,000.00	298,600.00	0.36%
GARAN.E	34,026.00	352,849.62	0.42%
GARAN.E	65,056.00	674,630.72	0.80%
GARAN.E	40,000.00	414,800.00	0.49%
ISCTR.E	17,436.00	122,052.00	0.15%
ISCTR.E	40,000.00	280,000.00	0.33%
ISCTR.E	34,610.00	242,270.00	0.29%
ISMEN.E	5,565.00	98,277.90	0.12%
ISMEN.E	8,347.00	147,408.02	0.18%
ISMEN.E	11,455.00	202,295.30	0.24%
ISMEN.E	15,145.00	267,460.70	0.32%
KCHOL.E	25,632.00	541,347.84	0.65%
KCHOL.E	10,853.00	229,215.36	0.27%
KOZAL.E	3,537.00	342,027.90	0.41%
KOZAL.E	1,167.00	112,848.90	0.13%
KOZAL.E	1,604.00	155,106.80	0.18%

KOZAL.E	2,114.00	204,423.80	0.24%
KRDMD.E	25,648.00	148,245.44	0.18%
KRDMD.E	16,695.00	96,497.10	0.12%
KRDMD.E	22,936.00	132,570.08	0.16%
KRDMD.E	27,641.00	159,764.98	0.19%
LOGO.E	1,385.00	173,817.50	0.21%
MGROS.E	1,996.00	85,428.80	0.10%
MGROS.E	834	35,695.20	0.04%
MGROS.E	1,146.00	49,048.80	0.06%
MGROS.E	1,683.00	72,032.40	0.09%
OYAKC.E	3,964.00	34,803.92	0.04%
OYAKC.E	10,000.00	87,800.00	0.10%
OYAKC.E	5,836.00	51,240.08	0.06%
OYAKC.E	8,026.00	70,468.28	0.08%
OYAKC.E	11,769.00	103,331.82	0.12%
PETKM.E	10,925.60	54,409.49	0.06%
PETKM.E	16,508.40	82,211.83	0.10%
PETKM.E	12,000.00	59,760.00	0.07%
PETKM.E	27,129.00	135,102.42	0.16%
PETKM.E	80,000.00	398,400.00	0.47%
SISE.E	18,781.00	137,289.11	0.16%
SISE.E	55,000.00	402,050.00	0.48%
SISE.E	31,265.00	228,547.15	0.27%
TCELL.E	10,808.00	174,008.80	0.21%
TCELL.E	15,399.00	247,923.90	0.30%
TCELL.E	18,268.00	294,114.80	0.35%
TCELL.E	30,000.00	483,000.00	0.58%
TCELL.E	25,000.00	402,500.00	0.48%
THYAO.E	23,391.00	301,977.81	0.36%
THYAO.E	13,716.00	177,073.56	0.21%
TOASO.E	3,422.00	116,074.24	0.14%
TOASO.E	3,339.00	113,258.88	0.14%
TOASO.E	4,583.00	155,455.36	0.19%
TOASO.E	4,801.00	162,849.92	0.19%
TUPRS.E	836	90,288.00	0.11%
TUPRS.E	2,000.00	216,000.00	0.26%
TUPRS.E	3,382.00	365,256.00	0.44%
TUPRS.E	2,000.00	216,000.00	0.26%
TUPRS.E	3,500.00	378,000.00	0.45%
TURSG.E	51,873.00	342,361.80	0.41%
Ana Grup Toplamı	1,562,699.00	18,203,695.45	21.69%
B.BORÇLANMA ARAÇLARI			
B.1.ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI			
TAHVİL			
TRSENSA32314	2,000,000.00	3,075,229.72	3.67%
TRSENSA72211	500,000.00	819,271.33	0.98%
TRSHEKT32123	250,000.00	252,754.62	0.30%
TRSTHALE2716	1,000,000.00	998,714.04	1.19%
TRSTISB22212	3,000,000.00	3,068,292.62	3.66%
TRSTISB72712	1,500,000.00	1,546,082.08	1.84%
TRSVKFB92719	1,000,000.00	1,073,289.37	1.28%
Toplam	9,250,000.00	10,833,633.78	12.92%
BONO			
FINANSMAN BONOSU			
GOS(GELİR ORT.SEN)			
GES(GELİRE END.SEN)			
VDMK(VAR DAY MEN K)			
DIŞ BORÇLANMA ARACI			
Ara Grup Toplamı	9,250,000.00	10,833,633.78	12.91%
B.2.KAMU SEKTÖRÜ BORÇLANMA ARAÇLARI			
TAHVİL			
TRT011025T16	2,500,000.00	2,559,577.14	3.05%
TRT011025T16	500,000.00	511,915.43	0.61%
TRT270923T11	1,500,000.00	1,368,861.76	1.63%
Toplam	4,500,000.00	4,440,354.33	5.29%
BONO			
FINANSMAN BONOSU			
GOS(GELİR ORT.SEN)			
GES(GELİRE END.SEN)			
VDMK(VAR DAY MEN K)			
DIŞ BORÇLANMA ARACI			
US900123CL22	500,000.00	4,004,483.89	4.77%
US900123CR91	500,000.00	4,063,494.09	4.84%
US900123CW86	400,000.00	3,138,156.91	3.74%
Toplam	1,400,000.00	11,206,134.89	13.35%
Ara Grup Toplamı	5,900,000.00	15,646,489.22	18.65%
Ana Grup Toplamı	15,150,000.00	26,480,123.00	31.56%
C.KİRA SERTİFİKALARI			
KİRA SERTİFİKASI			
Ç.TÜREV ARAÇLAR			
TÜREV TEMİNAT			
VIOP-TL	3,044,439.27	2,926,139.27	3.49%
OTC-USD	406.99	3,019.62	
Toplam	3,044,846.26	2,929,158.89	3.49%
ALIM OPSİYONU			
Ç.1.VIOP OPSİYON			
VIOP ALIM OPSİYONU			
VIOP SATIM OPSİYONU			
Ana Grup Toplamı	3,044,846.26	2,929,158.89	3.49%
D.YABANCI SERMAYE PİYASASI ARAÇLARI			
YABANCI TAHVİL			

İKRAZ İŞT. SER				
YABANCI KIRA SER				
YP HİSSE				
BORSA YATIRIM FONLARI				
DGTLN	5,000.00	374,865.19	0.45%	
EXIUS	1,500.00	1,187,808.84	1.42%	
EXIUS	715	566,188.88	0.67%	
HEALLN	6,000.00	458,207.31	0.55%	
IWQULN	1,250.00	437,837.34	0.52%	
RBOTLN	5,000.00	441,009.14	0.53%	
SUASLN	15,000.00	1,192,483.07	1.42%	
SUASLN	7,150.00	568,416.93	0.68%	
Toplam	41,615.00	5,226,816.70	6.24%	
YP VARANT				
Ana Grup Toplamı	41,615.00	5,226,816.70	6.23%	
E.ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER				
KIYMETLİ MADEN				
ALT	4,000.00	1,795,032.99	2.14%	
Ana Grup Toplamı	4,000.00	1,795,032.99	2.13%	
F.VARANTLAR				
G.DİĞER VARLIKLAR				
TERS REPO				
TRT160425T33	280,337.53	280,084.34	0.33%	
TRT230222T13	460,554.52	460,138.57	0.55%	
TRT280628T18	27,051,041.10	27,012,751.24	32.20%	
Toplam	27,791,933.15	27,752,974.15	33.08%	
REPO				
TAKASBANK BORSA PARA PİYASASI				
MEVDUAT				
VADELI	1,502,858.32	1,500,713.11	1.79%	
Toplam	1,502,858.32	1,500,713.11	1.79%	
YP MEVDUAT				
YATIRIM FONU				
GAYRİMENKUL SERTİFİKASI				
Ana Grup Toplamı	29,294,791.47	29,253,687.26	34.87%	
FON PORTFOY DEĞERİ	49,097,951.73	83,888,514.28		
IV- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU				
	Tutarı (TL)	%		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	83,888,514.28	96.32%		
B. HAZİR DEĞERLER (+) :	28,493.58	0.03%		
C. ALACAKLAR (+) :	4,027,347.77	4.62%		
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0			
E. BORÇLAR (-) :	850,508.95	0.98%		
FON TOPLAM DEĞERİ:	87,093,846.68			
V- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER				
Açıklama	Tutarı (TL)			
370.01.000-Fon Yönetim Ücreti	145,612.15			
370.02.000-Denetim Ücreti	6,542.24			
370.03.000-Tahvil Borsa Payı	5,475.17			
370.04.000-Aracılık Komisyonu	7,531.65			
370.04.200-Brokerage Komisyonu	3,137.13			
370.05.000-Vergi ve Resim Harç	58.8			
370.06.000-Saklama Giderleri	6,950.35			
370.15.001-BPP Kom	25.62			
370.20.001-SPK Kayda Alma Mas	1,258.99			
370.23.000-Futures İşlemi Kom	2,938.13			
370.27.000-BPP İşlem Masrafı	9.97			
370.28.000-Portföy Saklama Gideri	6,108.98			
370.33.000-Borsa Futures İşlemi Kom	1,991.14			
TOPLAM	187,640.32			
VI- GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMİ TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR				
Açıklama	Nominal (TL)			
ASELS Tem:% 5	21,021.00			
VII- PORTFÖYDEN SATIŞLAR				
Sermaye Piyasası Aracı	İhraççı Kurum	Satış Tarihi	Nominal (TL)	Satış Değ. (TL)
VIII- İTFALAR				
Sermaye Piyasası Aracı	İtfa Tarihi	Nominal (TL)		
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
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301220-GRM	VIOP-01.12.2020	1,452.75	250
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301220-GRM	VIOP-16.12.2020	1,565.75	6
				3,631,875.00 Kısa
				93,945.00 Uzun

[illegible]

Futures S��

Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301220-GRM	VIOP-31.12.2020	1,637.50	2	32,750.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301220-GRM	VIOP-31.12.2020	1,637.50	1	16,375.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301220-GRM	VIOP-31.12.2020	1,637.50	43	704,125.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301220-GRM	VIOP-31.12.2020	1,637.50	1	16,375.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301220-GRM	VIOP-31.12.2020	1,637.50	1	16,375.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301220-GRM	VIOP-31.12.2020	1,637.50	1	16,375.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301220-GRM	VIOP-31.12.2020	1,637.50	1	16,375.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301220-GRM	VIOP-31.12.2020	1,637.50	1	16,375.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301220-GRM	VIOP-31.12.2020	1,637.50	6	98,250.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301220-GRM	VIOP-31.12.2020	1,637.50	34	556,750.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_XU0301220-GRM	VIOP-31.12.2020	1,637.50	92	1,506,500.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1220-GRM	VIOP-31.12.2020	7.426	401	2,977,826.00	Uzun
Futures Sözleşmesi-VIOP	F_USDTRY1220-GRM	VIOP-31.12.2020	7.426	349	2,591,674.00	Uzun

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	
01.12.2020		33,539.00	84,735.00	2.379076	2.361603	39,539,023.00 TL	
02.12.2020		83,987.00	63,160.00	2.361603	2.379125	39,522,446.00 TL	
03.12.2020		79,737.00	141,947.00	2.379125	2.380179	39,545,009.00 TL	
04.12.2020		119,384.00	138,029.00	2.380179	2.388725	39,173,849.00 TL	
07.12.2020		509,189.00	32,512.00	2.388725	2.389027	39,171,199.00 TL	
08.12.2020		35,162.00	45,925.00	2.389027	2.397219	38,681,774.00 TL	
09.12.2020		535,350.00	88,459.00	2.397219	2.400863	38,577,902.00 TL	
10.12.2020		192,331.00	221,064.00	2.400863	2.405215	38,072,177.00 TL	
11.12.2020		726,789.00	103,291.00	2.405215	2.406316	38,134,813.00 TL	
14.12.2020		40,655.00	112,487.00	2.406316	2.421587	38,233,801.00 TL	
15.12.2020		13,499.00	252,107.00	2.421587	2.424053	37,682,310.00 TL	
16.12.2020		803,598.00	100,906.00	2.424053	2.427496	37,677,291.00 TL	
17.12.2020		105,925.00	240,592.00	2.427496	2.425622	36,762,132.00 TL	
18.12.2020		1,155,751.00	204,769.00	2.425622	2.427919	35,965,007.00 TL	
21.12.2020		1,001,894.00	49,318.00	2.427919	2.43018	36,004,685.00 TL	
22.12.2020		9,640.00	227,196.00	2.43018	2.416581	36,123,817.00 TL	
23.12.2020		108,064.00	106,008.00	2.416581	2.421293	36,164,266.00 TL	
24.12.2020		65,559.00	163,684.00	2.421293	2.425324	35,675,270.00 TL	
25.12.2020		652,680.00	98,649.00	2.425324	2.42783	35,650,643.00 TL	
28.12.2020		123,276.00	123,255.00	2.42783	2.428894	35,663,270.00 TL	
29.12.2020		110,628.00	167,966.00	2.428894	2.431416	35,436,776.00 TL	
30.12.2020		394,460.00	586,459.00	2.431416	2.432914	35,890,354.00 TL	
31.12.2020		132,881.00	109,031.00	2.432914	2.437395	35,723,180.00 TL	