

YKP**(YBE) YAPI KREDİ PORTFOY EUROBOND (DOLAR) BORCLANMA ARAÇLARI FONU****ŞUBAT 2018 AYLIK RAPORUDUR.****1- FONU TANITICI BİLGİLER**

A. FONUN ADI	:	(YBE) YAPI KREDİ PORTFOY EUROBOND (DOLAR) BORCLANMA ARAÇLARI FONU
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFOY YONETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	1,000,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	1,142,883,551.06
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	10,849,953,378.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	29.06.2000
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.105335
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.106171
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	-0.79%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	-1.67%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	8.44%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		2.52%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		1.54%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-YP		0.41%
Kira Sertifikası-Özel Sektör-TL		0.00%
Kira Sertifikası-Özel Sektör-YP		0.00%
Devlet Tahvili Repo		0.00%
Özel Sek. Tahvili Repo		0.00%
Kuponlar Repo		0.00%
Hazine Bonosu Repo		0.00%
Devlet Tahvili Ters Repo		0.00%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		5.04%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		87.67%
Yabancı Hisse Senetleri		0.00%
VIOP Nakit Teminat		0.71%

Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	0.56%
Vadeli_YP	1.10%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	0.11%
Katılma Belgesi YP	0.34%
CC Swap	0.00%
VDMK	0.00%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	21.72%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	9.92%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	2956.707
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	130,733,582.00
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	44,853,327.24

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT110827T16	50,000,000.00	47,033,000.00	4.08
TOPLAM	50,000,000.00	47,033,000.00	4.08
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFAKFK51816	5,000,000.00	4,873,300.00	0.42
TOPLAM	5,000,000.00	4,873,300.00	0.42
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ			
TRSAYGZ12024	3,500,000.00	3,547,845.00	0.31
TRSDGOZ71918	2,016,000.00	2,016,000.00	0.18
TRSKCTF71913	5,000,000.00	5,091,250.00	0.44
TRSKRSNE2018	400,000.00	408,884.00	0.04
TRSOPAS22012	2,000,000.00	2,005,580.00	0.17
TRSOTKO22012	5,000,000.00	5,002,000.00	0.43
TRSYDAT71814	1,000,000.00	1,015,920.00	0.09
TOPLAM	18,916,000.00	19,087,479.00	1.66
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
H) KİRA SERTİFİKALARI			
XS1141043296	1,250,000.00	4,698,756.52	0.41
TOPLAM	1,250,000.00	4,698,756.52	0.41
VALÖRLÜ İŞLEMLER			

D) YABANCI MENKUL KIYMETLER

IEF US	10000.00	3877555.85	0.34
US900123AL40	8330000.00	48327727.33	4.20
US900123AT75	7170000.00	32060016.63	2.78
US900123AW05	9140000.00	39192141.30	3.40
US900123AY60	7480000.00	30917754.61	2.68
US900123BB58	3180000.00	13732260.95	1.19
US900123BG46	1700000.00	6838565.17	0.59
US900123BJ84	5700000.00	20835166.69	1.81
US900123CG37	55000000.00	212140195.77	18.42
US900123CJ75	3600000.00	12871932.11	1.12
US900123CL22	12000000.00	47956925.63	4.16
US900123CM05	23000000.00	80534489.51	6.99
US900123CP36	1000000.00	3654589.46	0.32
XS0861979440	849000.00	3195508.51	0.28
XS1003016018	3515000.00	14387625.51	1.25
XS1028943089	1500000.00	5850844.55	0.51
XS1063442484	250000.00	994851.70	0.09
XS1079527211	4000000.00	15247208.18	1.32
XS1121459074	4020000.00	15643145.66	1.36
XS1175854923	6050000.00	23408523.96	2.03
XS1219733752	2294000.00	8930371.42	0.78
XS1223394914	500000.00	1918905.50	0.17
XS1345632811	1700000.00	6610189.90	0.57
XS1376681067	15263000.00	64349023.67	5.59
XS1390320981	1600000.00	6211141.61	0.54
XS1396282177	8000000.00	32582731.48	2.83
XS1412393172	2000000.00	7630557.54	0.66
XS1496463297	1500000.00	5828473.82	0.51
XS1508390090	1400000.00	5406501.94	0.47
XS1508914691	6600000.00	25583718.27	2.22
XS1551747733	5900000.00	23753347.69	2.06
XS1571399754	4000000.00	15377841.86	1.34
XS1578203462	4680000.00	18088278.83	1.57
XS1584113184	10214000.00	40736282.84	3.54
XS1605397394	2300000.00	8849731.18	0.77
XS1613091500	3100000.00	11664577.44	1.01
XS1617531063	1000000.00	3838095.97	0.33
XS1622626379	2800000.00	10728369.36	0.93
XS1634372954	5200000.00	19702128.45	1.71
XS1684378208	1100000.00	4115135.90	0.36
XS1686704948	1000000.00	3748309.06	0.33
XS1750996206	4900000.00	18434485.83	1.60
TOPLAM	244,545,000.00	975,755,228.62	84.71

İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER

J) REPO

K) TERS REPO

L) DİĞER

YPK	957,775.00	1,236,301.72	0.11
-----	------------	--------------	------

KIS		51,466,803.00	717,961.90	0.06
Vadeli Mevduat YP gün 35		5,368,000.00	20,433,627.20	1.77
Vadeli Mevduat gün 36		5,142,542.62	5,171,117.36	0.45
F_USDTRY0418		-10,000.00	-38,720,000.00	
BPP		19,435,999.77	19,435,999.77	1.69
BPP		24,563,947.44	24,563,947.44	2.13
BPP		18,620,808.13	18,620,808.13	1.62
BPP		1,964,721.03	1,964,721.03	0.17
TOPLAM			92,144,484.55	8.00
M) VARANT	:			
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:			
		8,253,464.52	8,253,464.52	0.72
TOPLAM		8,253,464.52	8,253,464.52	0.72
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
O) VDMK	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU	:			
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	1,151,845,713.20		
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	6,147.70		
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00		
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00		
E. BORÇLAR (-)	:	6,952,309.84		
FON TOPLAM DEĞERİ	:	1,142,883,551.06		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	:			
Açıklama			Tutarı	
37001 Fon Yönetim Ücreti		1,312,506.15		
37002 Denetim Ücreti		397.60		
37005 Vergi, Resim ve Harçlar		5,608.23		
37006 Saklama Giderleri		11,665.30		
37008 Banka Masrafları		467.72		
37010 Kap Gideri		222.60		
370142 KYD Endeks Lisans Giderleri		1,362.90		
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu		37,757.83		
37023 VIOP İşlemi Komisyonu		194,181.06		
37028 Portföy Saklama Hizmeti		2,276.75		
37030 E-fatura Gideri		153.16		
37099 Diğer Giderler		221.76		
Toplam		1,566,821.06		
6- GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI, BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM, TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLİNE İLİŞKİN AÇIKLAMALAR	:			
Açıklama		Giriş Tarihi	Stok	Kazanılan Nominal

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR

:

8- İTFALAR

:

Menkul Kıymet Türü

İtfâ Tarihi

Nominal

9- PORTFÖYE ALIŞLAR

: