

YKP**(YBP) YAPI KREDİ PORTFOY PY BİRİNCİ DEĞİŞKEN ÖZEL FON****ŞUBAT 2018 AYLIK RAPORUDUR.****1- FONU TANITICI BİLGİLER**

A. FONUN ADI	:	(YBP) YAPI KREDİ PORTFOY PY BİRİNCİ DEĞİŞKEN ÖZEL FON
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFOY YONETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	30,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	92,808,167.12
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	105,789,750.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	10.08.1998
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.877289
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.873944
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	0.38%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	0.61%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	9.52%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		33.95%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		10.03%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		3.70%
Kira Sertifikası-Kamu-YP		0.00%
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		6.61%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		45.71%
Yabancı Hisse Senetleri		0.00%
VIOP Nakit Teminat		0.00%

Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	0.00%
Vadeli_YP	0.00%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	0.00%
Katılma Belgesi YP	0.00%
CC Swap	0.00%
VDMK	0.00%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 0.21%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	95.11%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 1299.048
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 175.07
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	: 0.00

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT010420T19	35,000.00	67,792.55	0.07
TRT050220T17	3,000,000.00	2,754,540.00	2.73
TRT110827T16	5,069,000.00	4,768,205.54	4.72
TRT131119T19	4,200,000.00	4,374,384.00	4.33
TRT140922T17	14,000.00	12,871.46	0.01
TRT141118T19	2,600,000.00	2,597,348.00	2.57
TRT150519T15	6,000,000.00	6,086,160.00	6.02
TRT170221T12	3,500,000.00	3,368,400.00	3.33
TRT170822T15	5,000,000.00	4,774,600.00	4.72
TRT220921T18	3,200,000.00	3,047,840.00	3.02
TRT240724T15	27,000.00	24,086.70	0.02
TRT270923T11	10,000.00	9,188.70	0.01
TOPLAM	32,655,000.00	31,885,416.95	31.55
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
TRT110226T13	5,000,000.00	4,741,500.00	4.69
TRT180123T10	3,000,000.00	3,052,740.00	3.02
TOPLAM	8,000,000.00	7,794,240.00	7.71
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ			
TRSAKYP41612	428,128.00	450,138.06	0.45

TRSAYGZ12024	1,000,000.00	1,013,670.00	1.00
TRSAYGZ31818	375,000.00	384,506.25	0.38
TRSICICE1818	555,000.00	569,596.50	0.56
TRSKCTY32015	160,000.00	161,939.20	0.16
TRSLMAK31815	900,000.00	927,549.00	0.92
TRSOTKOK1815	650,000.00	660,523.50	0.65
TRSTIMG41917	900,000.00	924,129.00	0.91
TRSTIMGE1918	110,000.00	112,940.30	0.11
TRSTISB72712	1,580,000.00	1,602,752.00	1.59
TRSTTRK42012	500,000.00	514,850.00	0.51
TRSVKFB92719	2,080,000.00	2,145,873.60	2.12
TOPLAM	9,238,128.00	9,468,467.41	9.37
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
TRD220921T16	2,970,000.00	3,466,019.70	3.43
TOPLAM	2,970,000.00	3,466,019.70	3.43
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
US900123AL40	1100000.00	6381812.73	6.31
US900123AW05	750000.00	3215985.34	3.18
US900123BA75	1018000.00	3989069.26	3.95
US900123BD15	2301000.00	9344941.66	9.25
US900123BH29	1362000.00	5508784.24	5.45
US900123CG37	1000000.00	3857094.47	3.82
US900123CJ75	1400000.00	5005751.38	4.95
US900123CL22	1000000.00	3996410.47	3.95
US900123CM05	400000.00	1400599.82	1.39
TOPLAM	10,331,000.00	42,700,449.35	42.25
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
L) DİĞER	:		
BPP	5,749,101.99	5,749,101.99	5.69
TOPLAM		5,749,101.99	5.69
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
O) VDMK	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU	:		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	101,063,695.41	
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	3,189.90	
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00	
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00	
E. BORÇLAR (-)	:	7,808,580.13	
FON TOPLAM DEĞERİ	:	92,808,167.12	

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

:

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	7,093.64
37002 Denetim Ücreti	397.60
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	650.46
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	694.36
37006 Saklama Giderleri	1,533.12
37008 Banka Masrafları	339.90
37010 Kap Gideri	222.60
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	4,090.06
37028 Portföy Saklama Hizmeti	1,802.50
37030 E-fatura Gideri	153.16
37099 Diğer Giderler	221.76
Toplam	17,199.16

6- GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI
KULLANIMI, BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI,
TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA
İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

:

Açıklama	Giriş Tarihi	Stok	Kazanılan Nominal
----------	--------------	------	-------------------

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR

:

8- İTFALAR

:

Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal
--------------------	-------------	---------

9- PORTFÖYE ALIŞLAR

: