

YKP
(YDP) YAPI KREDİ PORTFOY PY ÜÇÜNCÜ DEĞİSKEN ÖZEL FON
ŞUBAT 2018 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	(YDP) YAPI KREDİ PORTFOY PY ÜÇÜNCÜ DEĞİSKEN ÖZEL FON
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFOY YONETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	300,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	373,813,730.80
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	21,534,511,416.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	20.07.2012
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.017359
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.017220
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	0.81%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	2.24%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	14.41%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		8.10%
Devlet Tahvili		35.10%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		19.24%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		1.28%
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		6.08%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		15.48%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.00%
Yabancı Hisse Senetleri		0.00%
VIOP Nakit Teminat		0.75%

Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	8.74%
Vadeli_YP	0.00%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	4.97%
Katılma Belgesi YP	0.00%
CC Swap	0.00%
VDMK	0.25%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	42.99%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	16.10%
Devlet Borçlanma Senetleri	21.22%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	368.592
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	0.00
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	4,828,999.97

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
AKBNK	220,000.00	2,338,600.00	0.63
AKSEN	198,500.00	946,845.00	0.25
ARCLK	32,500.00	615,875.00	0.17
ASELS	68,000.00	2,118,880.00	0.57
ENKAI	0.50	2.75	0.00
EREGL	240,000.00	2,726,400.00	0.73
GARAN	210,000.00	2,463,300.00	0.66
ISCTR	320,000.00	2,432,000.00	0.65
ISGYO	1.03	1.42	0.00
KAREL	80.00	654.40	0.00
KCHOL	147,500.00	2,653,525.00	0.71
KRDMD	600,000.00	2,064,000.00	0.55
MAVI	13,894.00	741,244.90	0.20
MGROS	55,000.00	1,324,400.00	0.35
ODAS	110,500.58	850,854.47	0.23
OTKAR	4,000.00	476,000.00	0.13
PEKGY	100,000.00	550,000.00	0.15
PETKM	250,000.00	2,017,500.00	0.54
PGSUS	56,000.00	1,985,760.00	0.53
SISE	0.53	2.54	0.00
SODA	0.92	4.64	0.00
TCELL	160,000.00	2,454,400.00	0.66
TUPRS	13,500.00	1,578,150.00	0.42
VAKBN	1.00	7.35	0.00
YKBNK	105,000.00	499,800.00	0.13

TOPLAM	2,904,478.56	30,838,207.47	8.26
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI :			
TRT100719T18	6,000,000.00	5,762,100.00	1.54
TRT110718T18	39,500,000.00	39,383,475.00	10.55
TRT110827T16	11,469,000.00	10,788,429.54	2.89
TRT120325T12	20,000.00	17,293.00	0.00
TRT131119T19	7,200,000.00	7,498,944.00	2.01
TRT150120T16	16,800,000.00	16,446,192.00	4.41
TRT150519T15	2,200,000.00	2,231,592.00	0.60
TRT170221T12	4,800,000.00	4,619,520.00	1.24
TRT170822T15	6,200,000.00	5,920,504.00	1.59
TRT200324T13	67,000.00	66,520.28	0.02
TRT200618T18	23,200,000.00	23,250,344.00	6.23
TRT220921T18	4,300,000.00	4,095,535.00	1.10
TRT240724T15	18,622,000.00	16,612,686.20	4.45
TOPLAM	140,378,000.00	136,693,135.02	36.63
VALÖRLÜ İŞLEMLER :			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ :			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.) :			
E) DÖVİZE ENDEKSİ TAHVİLLER :			
F) FİNANSMAN BONOLARI :			
TRFAKYM31815	1,500,000.00	1,483,815.00	0.40
TRFFINF61812	2,000,000.00	1,928,240.00	0.52
TRFFNBK31836	3,000,000.00	2,966,190.00	0.79
TRFFNBK41884	2,000,000.00	1,961,700.00	0.53
TRFGRFA51819	2,000,000.00	1,947,640.00	0.52
TRFGVYA41813	1,000,000.00	983,720.00	0.26
TRFHLFK61818	3,000,000.00	2,863,560.00	0.77
TRFISFN11927	2,470,000.00	2,169,178.70	0.58
TRFSKBK31819	1,500,000.00	1,489,065.00	0.40
TRFVDTF51818	2,000,000.00	1,941,780.00	0.52
TRFVFAS71822	2,000,000.00	1,892,560.00	0.51
TRFYKFK61815	1,000,000.00	963,610.00	0.26
TOPLAM	23,470,000.00	22,591,058.70	6.05
VALÖRLÜ İŞLEMLER :			
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ :			
TRSAKFK81816	450,000.00	454,765.50	0.12
TRSAKYBE1841	3,000,000.00	3,045,300.00	0.82
TRSAYGZ12024	1,000,000.00	1,013,670.00	0.27
TRSAYGZ31818	1,500,000.00	1,538,025.00	0.41
TRSCLKM31910	2,000,000.00	2,136,840.00	0.57
TRSENSA72211	5,100,000.00	5,434,815.00	1.46
TRSGFYH31914	1,360,000.00	1,399,208.80	0.37
TRSIICE1818	2,210,000.00	2,268,123.00	0.61
TRSKCTF11919	1,400,000.00	1,408,554.00	0.38
TRSKCTY62012	1,000,000.00	1,027,770.00	0.28
TRSKCTYE1815	2,670,000.00	2,732,664.90	0.73
TRSKFTF81816	1,000,000.00	994,260.00	0.27
TRSKFTFA1819	500,000.00	448,950.00	0.12

TRSKRSNE2018	2,000,000.00	2,044,420.00	0.55
TRSLMAK31815	2,000,000.00	2,061,220.00	0.55
TRSNBLI81810	1,000,000.00	1,007,380.00	0.27
TRSOPAS22111	1,000,000.00	1,002,770.00	0.27
TRSTATKK1816	25,000.00	25,016.75	0.01
TRSTBTF51819	1,000,000.00	1,002,620.00	0.27
TRSTHALE2716	500,000.00	503,870.00	0.14
TRSTISB72712	5,000,000.00	5,072,000.00	1.36
TRSVKFB92719	2,000,000.00	2,063,340.00	0.55
TRSYDAT71814	1,000,000.00	1,015,920.00	0.27
TRSYKFK81816	5,250,000.00	5,304,390.00	1.42
TRSZFKL21916	2,630,000.00	2,652,013.10	0.71
XS1629734879	2,350,000.00	2,353,466.25	0.63
TOPLAM	48,945,000.00	50,011,372.30	13.40
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
TRD220921T16	4,120,000.00	4,808,081.20	1.29
TOPLAM	4,120,000.00	4,808,081.20	1.29
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
L) DİĞER	:		
GLDTRf	1,250,000.00	18,426,250.00	4.94
Vadeli Mevduat gün 49	7,000,000.00	7,075,270.44	1.90
Vadeli Mevduat gün 49	2,000,000.00	2,021,359.19	0.54
Vadeli Mevduat gün 49	2,000,000.00	2,021,359.19	0.54
Vadeli Mevduat gün 49	7,000,000.00	7,076,810.31	1.90
Vadeli Mevduat gün 49	8,000,000.00	8,086,023.36	2.17
Vadeli Mevduat gün 49	6,500,000.00	6,570,132.34	1.76
F_EURTRY0418	2,000.00	9,491,800.00	
F_USDTRY0418	5,900.00	22,844,800.00	
F_XAUUSD0418	1,000.00	5,035,999.50	
BPP	10,131,369.86	10,083,156.03	2.70
BPP	10,104,712.33	10,063,503.74	2.70
BPP	10,025,602.74	10,021,932.36	2.69
BPP	17,960,468.36	17,960,468.36	4.81
BPP	15,211,499.16	15,211,499.16	4.08
BPP	10,003,630.14	10,003,630.14	2.68
TOPLAM		124,621,394.62	33.39
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		
	2,719,453.16	2,719,453.16	0.73
TOPLAM	2,719,453.16	2,719,453.16	0.73
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
O) VDMK	:		
TRPAK5F81818	1,000,000.00	935,980.00	0.25

TOPLAM	1,000,000.00	935,980.00	0.25
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU :

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	373,218,682.47
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	6,150.07
C. ALACAKLAR (+)	:	667,649.80
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	78,751.54
FON TOPLAM DEĞERİ	:	373,813,730.80

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER :

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	57,160.34
37002 Denetim Ücreti	397.60
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	400.23
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	3,801.00
37004 Aracılık Komisyonu	3,213.77
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	5,725.23
37006 Saklama Giderleri	3,271.46
37008 Banka Masrafları	429.91
37010 Kap Gideri	222.60
370141 İMKB Endeksi Lisans Sözleşmesi	1,239.00
370142 KYD Endeks Lisans Giderleri	1,858.50
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	23,543.44
37023 VIOP İşlemi Komisyonu	39,329.07
37028 Portföy Saklama Hizmeti	2,038.75
37030 E-fatura Gideri	153.16
37098 Küsürat farkları	0.14
37099 Diğer Giderler	221.76
Toplam	143,005.96

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	İtfat Tarihi	Nominal
TRSORFN21812	02.02.2018	2000000.00
TRFISMD21840	06.02.2018	4000000.00
TRT140218T10	14.02.2018	2000000.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR :