

YKP
(YOD) YAPI KREDİ PORTFOY İKİNCİ DEĞİSKEN FON
ŞUBAT 2018 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	(YOD) YAPI KREDİ PORTFOY İKİNCİ DEĞİSKEN FON
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFOY YONETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	250,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	97,283,817.31
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	5,762,338,372.75
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	30.12.2010
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.016883
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.016946
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	-0.37%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	1.17%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	10.28%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		16.55%
Devlet Tahvili		24.05%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		26.94%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		0.08%
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		2.13%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		5.00%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		2.03%
Yabancı Hisse Senetleri		0.00%
VIOP Nakit Teminat		3.50%

Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	8.41%
Vadeli_YP	0.00%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	3.68%
Katılma Belgesi YP	7.63%
CC Swap	0.00%
VDMK	0.00%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	5.76%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	95.16%
Devlet Borçlanma Senetleri	121.26%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	741.472
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	3,417,488.10
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	1,868,694.66

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
ADANA	0.56	3.49	0.00
AKBNK	0.65	6.88	0.00
AKSEN	250,000.00	1,192,500.00	1.22
ALARK	0.01	0.08	0.00
ANHYT	0.40	3.01	0.00
ANSGR	0.84	3.46	0.00
ASELS	125,000.00	3,895,000.00	3.97
CEMTS	275,000.00	1,292,500.00	1.32
DGATE	50,000.00	836,000.00	0.85
DGGYO	0.97	3.07	0.00
DGKLB	125,000.00	438,750.00	0.45
DOHOL	2.38	1.90	0.00
ENKAI	1.98	10.88	0.00
EREGL	3.99	45.36	0.00
GARAN	0.00	0.01	0.00
HURGZ	0.12	0.12	0.00
ISCTR	0.66	5.02	0.00
ISFIN	2.74	5.05	0.00
ISGYO	1.02	1.41	0.00
KAREL	275,000.00	2,249,500.00	2.29
KCHOL	0.88	15.80	0.00
KRDMD	0.30	1.03	0.00
MAVI	25,000.00	1,333,750.00	1.36
ODAS	500,000.00	3,850,000.00	3.92
PEKGY	125,000.00	687,500.00	0.70

PETKM	0.75	6.04	0.00
QNBFB	0.29	1.72	0.00
SAHOL	0.14	1.49	0.00
SISE	2.19	10.49	0.00
SKBNK	0.71	1.14	0.00
SNGYO	1.00	0.75	0.00
SODA	0.59	3.00	0.00
TCELL	0.97	14.86	0.00
THYAO	0.19	3.70	0.00
TKFEN	0.08	1.36	0.00
TOASO	0.44	13.40	0.00
TRKCM	7.36	35.71	0.00
VAKBN	0.16	1.18	0.00
YKBNK	0.45	2.14	0.00
TOPLAM	1,750,032.82	15,775,703.55	16.08
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI :			
TRT180123T10	6,000,000.00	6,112,800.00	6.23
TRT240724T15	24,300,000.00	21,678,030.00	22.10
TOPLAM	30,300,000.00	27,790,830.00	28.33
VALÖRLÜ İŞLEMLER :			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ :			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.) :			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER :			
F) FİNANSMAN BONOLARI :			
TRFNURL31813	1,000,000.00	995,180.00	1.01
TOPLAM	1,000,000.00	995,180.00	1.01
VALÖRLÜ İŞLEMLER :			
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ :			
TRSAFKK1910	2,000,000.00	2,353,860.00	2.40
TR SAYGZ31818	525,000.00	538,308.75	0.55
TRSAZEV21919	100,000.00	101,159.00	0.10
TRSDGOZ71918	400,000.00	400,000.00	0.41
TRSDOGH31910	1,010,000.00	1,050,703.00	1.07
TRSENSA72211	1,000,000.00	1,065,650.00	1.09
TRSFKR51813	1,000,000.00	1,005,450.00	1.02
TR SICICE1818	2,092,000.00	2,147,019.60	2.19
TR SISFN91815	1,500,000.00	1,544,445.00	1.57
TRSKFTF81816	2,000,000.00	1,988,520.00	2.03
TRSKRSNE2018	1,000,000.00	1,022,210.00	1.04
TRSLMAK31815	1,300,000.00	1,339,793.00	1.37
TRSNLOG21912	900,000.00	905,553.00	0.92
TRSOTKO22012	1,500,000.00	1,500,600.00	1.53
TRSRNSH11919	800,000.00	813,872.00	0.83
TRSSRTNA1817	500,000.00	518,615.00	0.53
TRSSRTNE1912	1,000,000.00	1,021,400.00	1.04
TRSTHALE2716	500,000.00	503,870.00	0.51
TRSTISB72712	1,000,000.00	1,014,400.00	1.03
TRSYDAT71814	1,300,000.00	1,320,696.00	1.35
TRSYKFK81816	2,750,000.00	2,778,490.00	2.83

XS1629734879	1,350,000.00	1,351,991.25	1.38
TOPLAM	25,527,000.00	26,286,605.60	26.79
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
TRD140721T18	80,000.00	75,092.00	0.08
TOPLAM	80,000.00	75,092.00	0.08
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
ASHR.K	21500.00	2591809.57	2.64
EEM	15850.00	2941702.09	3.00
XS1057541838	500000.00	1956066.56	1.99
TOPLAM	537,350.00	7,489,578.22	7.63
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
L) DİĞER	:		
Forward USD/TL	-12,812.00		
Forward USD/TL	-12,812.00		
Forward USD/TL	-12,812.00		
Forward USD/TL	-12,812.00		
Forward USD/TL	-500,000.00		
YAY	55,657.00	2,583,017.27	2.63
YPK	1,182,948.00	1,526,956.38	1.56
Vadeli Mevduat gün 49	2,000,000.00	2,021,505.84	2.06
Vadeli Mevduat gün 49	2,000,000.00	2,021,359.19	2.06
Vadeli Mevduat gün 49	2,000,000.00	2,021,945.80	2.06
Vadeli Mevduat gün 49	2,000,000.00	2,021,579.19	2.06
F_EURUSD0418	2,000.00	9,330,492.80	
F_USDTRY0418	-5,500.00	-21,296,000.00	
F_XAUUSD0418	1,000.00	5,035,999.50	
BPP	4,381,590.00	4,381,590.00	4.47
TOPLAM		16,577,953.67	16.90
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		
	3,113,369.35	3,113,369.35	3.17
TOPLAM	3,113,369.35	3,113,369.35	3.17
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
O) VDMK	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU	:		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	98,104,312.39	
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	4,319.66	
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00	
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00	
E. BORÇLAR (-)	:	424,814.74	
FON TOPLAM DEĞERİ	:	97,283,817.31	

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

:

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	189,984.08
37002 Denetim Ücreti	129.64
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	621.18
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	575.06
370034 Yabancı Menkul Komisyonu	102.75
37004 Aracılık Komisyonu	6,062.42
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	487.21
37006 Saklama Giderleri	1,345.43
37008 Banka Masrafları	248.29
37010 Kap Gideri	379.25
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	3,182.05
37023 VIOP İşlemi Komisyonu	40,167.06
37028 Portföy Saklama Hizmeti	1,531.25
37030 E-fatura Gideri	153.16
37098 Küsürat farkları	-0.01
37099 Diğer Giderler	221.76
Toplam	245,190.59

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
F_XU0300218	28.02.2018	500.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR

: