

YKP
(YOT) YAPI KREDİ PORTFOY ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
ŞUBAT 2018 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	(YOT) YAPI KREDİ PORTFOY ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFOY YONETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	9,487,209.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	116,300,962.29
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	21,781,620.89
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	29.08.1996
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	5.339408
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	5.294057
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	0.86%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	1.99%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	10.03%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		40.12%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		50.62%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		0.00%
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		0.80%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.00%
Yabancı Hisse Senetleri		0.00%
VIOP Nakit Teminat		0.00%

Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	8.46%
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. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	0.04%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	72.66%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	407.827
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	38,963,008.02
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	1,891,792.75

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT020322T17	1,200,000.00	1,223,088.00	1.05
TRT080720T19	27,000.00	25,693.47	0.02
TRT100719T18	25,000.00	24,008.75	0.02
TRT110718T18	3,600,000.00	3,589,380.00	3.08
TRT110827T16	5,600,000.00	5,267,696.00	4.52
TRT131119T19	2,000,000.00	2,083,040.00	1.79
TRT141118T19	2,900,000.00	2,897,042.00	2.49
TRT150120T16	3,000,000.00	2,936,820.00	2.52
TRT150519T15	6,400,000.00	6,491,904.00	5.57
TRT160119T18	2,838,000.00	2,545,288.68	2.19
TRT170221T12	1,900,000.00	1,828,560.00	1.57
TRT180123T10	5,000,000.00	5,094,000.00	4.37
TRT200219T11	2,500,000.00	3,597,775.00	3.09
TRT220921T18	6,300,000.00	6,000,435.00	5.15
TOPLAM	43,290,000.00	43,604,730.90	37.43
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFALFK41815	3,000,000.00	2,958,720.00	2.54
TRFFINF61812	3,000,000.00	2,892,360.00	2.48
TRFGVYA41813	1,000,000.00	983,720.00	0.84
TRFISFN61815	4,000,000.00	3,849,600.00	3.30

TRFKPTL41814	1,000,000.00	977,980.00	0.84
TRFNURL31813	1,200,000.00	1,194,216.00	1.03
TRFNURL71819	750,000.00	710,272.50	0.61
TRFOYMD51819	600,000.00	584,994.00	0.50
TRFVDTF51818	2,000,000.00	1,941,780.00	1.67
TRFVFAS71822	2,200,000.00	2,081,816.00	1.79
TRFYKFK61815	1,500,000.00	1,445,415.00	1.24
TRFYKYM31815	5,500,000.00	5,489,550.00	4.71
TOPLAM	25,750,000.00	25,110,423.50	21.56
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSAKFK81816	1,600,000.00	1,616,944.00	1.39
TRSAKFKK1910	1,500,000.00	1,765,395.00	1.52
TRSALJFK1813	1,000,000.00	1,043,860.00	0.90
TRSAYGZ31818	600,000.00	615,210.00	0.53
TRSCCLKM31910	2,000,000.00	2,136,840.00	1.83
TRSDOGH31910	1,030,000.00	1,071,509.00	0.92
TRSENSA72211	1,650,000.00	1,758,322.50	1.51
TRSGFYH31914	2,270,000.00	2,335,444.10	2.00
TRSICICE1818	740,000.00	759,462.00	0.65
TRISISFN91815	2,000,000.00	2,059,260.00	1.77
TRISISGYE1915	750,000.00	767,250.00	0.66
TRSKCTF41916	500,000.00	431,140.00	0.37
TRSKCTFA1812	1,000,000.00	1,030,190.00	0.88
TRSKCTYE1815	890,000.00	910,888.30	0.78
TRSKFTF51819	1,390,000.00	1,355,806.00	1.16
TRSKFTFA1819	1,000,000.00	897,900.00	0.77
TRSKRSNE2018	1,000,000.00	1,022,210.00	0.88
TRSNLOG21912	1,000,000.00	1,006,170.00	0.86
TRSOPAS22111	1,500,000.00	1,504,155.00	1.29
TRSORFN72013	1,500,000.00	1,527,900.00	1.31
TRSRNSHE1916	1,000,000.00	1,024,520.00	0.88
TRSSRTNA1817	1,000,000.00	1,037,230.00	0.89
TRSTBTF31910	800,000.00	691,168.00	0.59
TRSTBTF51819	1,000,000.00	1,002,620.00	0.86
TRSTHALE2716	500,000.00	503,870.00	0.43
TRSTIMG41917	500,000.00	513,405.00	0.44
TRSVKFB92719	2,000,000.00	2,063,340.00	1.77
TRSYDAT71814	1,000,000.00	1,015,920.00	0.87
TRSZFKL21916	1,760,000.00	1,774,731.20	1.52
XS1629734879	2,350,000.00	2,353,466.25	2.02
TOPLAM	36,830,000.00	37,596,126.35	32.28
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		

L) DİĞER	:			
Vadeli Mevduat gün 49		2,000,000.00	2,021,505.84	1.74
Vadeli Mevduat gün 49		3,000,000.00	3,032,918.71	2.60
Vadeli Mevduat gün 49		2,500,000.00	2,526,882.30	2.17
Vadeli Mevduat gün 49		2,500,000.00	2,526,973.98	2.17
BPP		67,024.51	67,024.51	0.06
TOPLAM			10,175,305.34	8.74

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	:	116,486,586.09
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	3,617.85
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	189,241.65
FON TOPLAM DEĞERİ	:	116,300,962.29

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER :

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	182,474.93
37002 Denetim Ücreti	103.60
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	749.91
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	190.73
37006 Saklama Giderleri	1,333.16
37008 Banka Masrafları	157.82
37010 Kap Gideri	216.72
370142 KYD Endeks Lisans Giderleri	1,150.50
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	492.40
37028 Portföy Saklama Hizmeti	2,038.75
37030 E-fatura Gideri	153.16
37099 Diğer Giderler	221.76
Toplam	189,283.44

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
--------------------	-------------	---------

TRFNURL21822

07.02.2018

750000.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR

: