

YKP
(YTP) YAPI KREDİ PORTFOY DORDUNCU DEĞİSKEN FON
ŞUBAT 2018 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	(YTP) YAPI KREDİ PORTFOY DORDUNCU DEĞİSKEN FON
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFOY YONETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	200,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	61,548,178.28
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	4,445,358,467.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	01.07.2014
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.013845
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.013827
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	0.13%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	1.56%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	12.32%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		16.55%
Devlet Tahvili		14.03%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		21.77%
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		7.14%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		15.81%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.00%
Yabancı Hisse Senetleri		0.00%
VIOP Nakit Teminat		2.78%

Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	8.77%
Vadeli_YP	0.00%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	4.45%
Katılma Belgesi YP	7.20%
CC Swap	0.00%
VDMK	1.50%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	8.95%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	114.78%
Devlet Borçlanma Senetleri	97.44%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	519.710
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	2,281,254.96
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	1,876,718.42

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
AKSEN	175,000.00	834,750.00	1.34
ASELS	81,000.00	2,523,960.00	4.06
CEMTS	175,000.00	822,500.00	1.32
DGATE	50,000.00	836,000.00	1.35
DGKLB	75,000.00	263,250.00	0.42
ISGYO	0.55	0.76	0.00
KAREL	175,000.00	1,431,500.00	2.30
KRDMD	0.18	0.60	0.00
MAVI	12,500.00	666,875.00	1.07
ODAS	250,000.00	1,925,000.00	3.10
PEKGY	75,000.00	412,500.00	0.66
SODA	0.86	4.38	0.00
TOPLAM	1,068,501.59	9,716,340.75	15.64
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT080720T19	63,000.00	59,951.43	0.10
TRT110827T16	11,669,000.00	10,976,561.54	17.66
TRT120325T12	27,000.00	23,345.55	0.04
TRT150120T16	3,000.00	2,936.82	0.00
TRT240724T15	2,014,000.00	1,796,689.40	2.89
TRT270923T11	2,000.00	1,837.74	0.00
TOPLAM	13,778,000.00	12,861,322.48	20.70
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSİLİ TAHVİLLER			

F) FİNANSMAN BONOLARI	:			
TRFGVYA41813		500,000.00	491,860.00	0.79
TRFNURL71819		1,000,000.00	947,030.00	1.52
TRFVDTF51818		1,000,000.00	970,890.00	1.56
TOPLAM		2,500,000.00	2,409,780.00	3.88
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:			
TRSAKYP41612		342,500.00	360,107.93	0.58
TRSAYGZ31818		375,000.00	384,506.25	0.62
TRSCMK31910		1,500,000.00	1,602,630.00	2.58
TRSDGOZ71918		160,000.00	160,000.00	0.26
TRSDOGH31910		630,000.00	655,389.00	1.05
TRSENSA72211		1,000,000.00	1,065,650.00	1.71
TRSFNF91815		1,000,000.00	1,029,630.00	1.66
TRSKRSNE2018		500,000.00	511,105.00	0.82
TRSLMAK31815		1,000,000.00	1,030,610.00	1.66
TRSOPAS22111		700,000.00	701,939.00	1.13
TRSSRTNE1912		500,000.00	510,700.00	0.82
TRSTBTF51819		1,500,000.00	1,503,930.00	2.42
TRSTISB72712		1,000,000.00	1,014,400.00	1.63
TRSYDAT71814		500,000.00	507,960.00	0.82
XS1629734879		650,000.00	650,958.75	1.05
TOPLAM		11,357,500.00	11,689,515.93	18.81
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
H) KİRA SERTİFİKALARI	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
ASHR.K		13220.00	1593661.51	2.56
EEM		9850.00	1828124.01	2.94
TOPLAM		23,070.00	3,421,785.52	5.51
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
L) DİĞER	:			
YAY		34,507.00	1,601,454.93	2.58
YPK		1,182,948.00	1,526,956.38	2.46
Vadeli Mevduat gün 49		1,500,000.00	1,516,129.38	2.44
Vadeli Mevduat gün 49		1,100,000.00	1,111,747.55	1.79
Vadeli Mevduat gün 49		1,500,000.00	1,516,459.35	2.44
Vadeli Mevduat gün 49		1,300,000.00	1,314,026.47	2.11
F_EURUSD0418		450.00	2,099,360.88	
F_USDTRY0418		-650.00	-2,516,800.00	
F_XAUUSD0418		350.00	1,762,599.83	
BPP		9,925,574.63	9,925,574.63	15.97
BPP		965,348.99	965,348.99	1.55
TOPLAM			19,477,697.67	31.34
M) VARANT	:			
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:			
		1,632,177.66	1,632,177.66	2.63

TOPLAM	1,632,177.66	1,632,177.66	2.63
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
O) VDMK	:		
TRPAK5F81818	1,000,000.00	935,980.00	1.51
TOPLAM	1,000,000.00	935,980.00	1.51
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	62,144,600.01
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	4,415.50
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	80,729.30
FON TOPLAM DEĞERİ	:	61,548,178.28

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	70,820.74
37002 Denetim Ücreti	397.60
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	181.88
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	747.34
370034 Yabancı Menkul Komisyonu	60.67
37004 Aracılık Komisyonu	4,715.82
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	1,211.97
37006 Saklama Giderleri	1,143.69
37008 Banka Masrafları	285.73
37010 Kap Gideri	222.60
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	6,211.48
37023 VIOP İşlemi Komisyonu	19,263.68
37028 Portföy Saklama Hizmeti	1,802.50
37030 E-fatura Gideri	153.16
37098 Küsürat farkları	0.01
37099 Diğer Giderler	221.76
Toplam	107,440.63

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	1000000.00
TRT140218T10	14.02.2018	10000.00

F_XU0300218

28.02.2018

375.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR

: