

YKP
(YHT) YAPI KREDİ PORTFOY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
AĞUSTOS 2018 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	(YHT) YAPI KREDİ PORTFOY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	387,343,250.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	765,113,260.75
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	13,007,784,694.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	31.07.2002
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.058820
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.057996
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.42%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	8.73%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	12.65%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		3.76%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		80.20%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		0.06%
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		6.31%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		1.65%
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	8.02%
Vadeli_YP	0.00%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	0.00%
Katılma Belgesi YP	0.00%
CC Swap	0.00%
FX Swap	0.00%
IR Swap	0.00%
VDMK	0.00%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	27.10%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	17.03%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	62.889
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	598,280,266.37
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	539,296,426.22

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT141118T19	5,000,000.00	5,012,100.00	0.65
TRT150519T15	4,000,000.00	3,815,680.00	0.50
TRT160119T18	5,738,000.00	5,381,498.06	0.70
TRT200219T11	10,000,000.00	15,782,000.00	2.06
TOPLAM	24,738,000.00	29,991,278.06	3.91
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFAKBKK1828	35,000,000.00	33,841,500.00	4.41
TRFAKBKK1836	10,000,000.00	9,611,100.00	1.25
TRFAKFK11919	10,000,000.00	9,321,200.00	1.22
TRFAKFKK1816	5,700,000.00	5,433,297.00	0.71
TRFAKYM91819	11,600,000.00	11,458,016.00	1.49
TRFDFKT91817	2,900,000.00	2,896,259.00	0.38
TRFFFKR11913	3,000,000.00	2,831,460.00	0.37
TRFFIBA91815	3,140,000.00	3,136,232.00	0.41
TRFFIBA91823	3,000,000.00	2,987,850.00	0.39
TRFFIBAE1827	10,000,000.00	9,813,800.00	1.28
TRFFIBAK1837	6,680,000.00	6,435,445.20	0.84
TRFFNBK91830	6,700,000.00	6,645,529.00	0.87

TRFFNBKE18A7	8,000,000.00	7,801,040.00	1.02
TRFFNBKK1838	3,000,000.00	2,907,570.00	0.38
TRFFNBKK1846	5,000,000.00	4,811,000.00	0.63
TRFGRAN91819	20,500,000.00	20,484,420.00	2.67
TRFGRAN91884	10,000,000.00	9,943,700.00	1.30
TRFGRANE1821	30,000,000.00	29,460,600.00	3.84
TRFGRFA21911	5,000,000.00	4,615,100.00	0.60
TRFGRFAK1815	16,200,000.00	15,745,104.00	2.05
TRFGRFKK1813	4,550,000.00	4,443,348.00	0.58
TRFHALKE1811	10,000,000.00	9,774,600.00	1.28
TRFHALKE1829	10,000,000.00	9,742,500.00	1.27
TRFHLFKK1818	5,000,000.00	4,834,150.00	0.63
TRFHLGY91814	8,250,000.00	8,198,272.50	1.07
TRFISFA91819	11,500,000.00	11,494,135.00	1.50
TRFISFAK1812	3,750,000.00	3,612,900.00	0.47
TRFISFN11927	6,590,000.00	6,228,340.80	0.81
TRFISFN91812	12,000,000.00	11,934,960.00	1.56
TRFISFN91820	10,000,000.00	9,930,400.00	1.30
TRFISFN91838	2,590,000.00	2,584,068.90	0.34
TRFISFNE1815	15,840,000.00	15,524,942.40	2.03
TRFISFNK1817	6,000,000.00	5,855,820.00	0.76
TRFISFNK1833	10,000,000.00	9,575,300.00	1.25
TRFISMDA1812	5,000,000.00	4,725,350.00	0.62
TRFISMDE1826	5,000,000.00	4,879,000.00	0.64
TRFISMDE1891	3,400,000.00	3,338,426.00	0.44
TRFISMDE18A2	6,820,000.00	6,634,700.60	0.87
TRFSKBKE1818	10,000,000.00	9,821,000.00	1.28
TRFTCZBE1810	20,000,000.00	19,677,600.00	2.57
TRFTCZBE1828	10,000,000.00	9,696,200.00	1.26
TRFTEBKE1815	20,000,000.00	19,685,000.00	2.57
TRFTEBKE1831	10,000,000.00	9,808,900.00	1.28
TRFTEBKE1849	15,000,000.00	14,554,050.00	1.90
TRFTEBKK1817	10,000,000.00	9,702,900.00	1.27
TRFTHALE1838	20,000,000.00	19,300,800.00	2.52
TRFVFAS11919	10,000,000.00	9,292,300.00	1.21
TRFVKFB91833	10,000,000.00	9,930,700.00	1.30
TRFVKFBK1838	10,000,000.00	9,662,800.00	1.26
TRFVKFKE1819	4,770,000.00	4,662,293.40	0.61
TRFYKBK91811	10,000,000.00	9,980,800.00	1.30
TRFYKBKE1844	5,000,000.00	4,853,950.00	0.63
TRFYKFKE1816	4,000,000.00	3,917,920.00	0.51
TRFYKFKE1824	10,000,000.00	9,860,800.00	1.29
TRFYKFKE1832	5,000,000.00	4,863,300.00	0.63
TRFYKFKK1826	15,000,000.00	14,398,050.00	1.88
TRFYKYME1811	15,000,000.00	14,725,050.00	1.92
TRFYKYME1829	5,000,000.00	4,887,950.00	0.64
TRFYKYMK1813	13,000,000.00	12,527,840.00	1.63
TOPLAM	573,480,000.00	559,301,639.80	72.96
VALÖRLÜ İŞLEMLER			

G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:			
TRSGFYH31914		4,530,000.00	4,712,830.80	0.61
TRSIGY32111		4,550,000.00	4,726,449.00	0.62
TRSKFTF42016		4,200,000.00	4,419,912.00	0.58
TRSOPAS22111		9,000,000.00	9,362,520.00	1.22
TRSOPAS42010		5,000,000.00	5,279,850.00	0.69
TRSRNSH22023		5,000,000.00	5,145,900.00	0.67
TRSTISB72712		5,000,000.00	5,111,250.00	0.67
TRSVKFB92719		5,000,000.00	5,200,700.00	0.68
TOPLAM		42,280,000.00	43,959,411.80	5.73
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
H) KİRA SERTİFİKALARI	:			
TRD130219T18		410,000.00	402,681.50	0.05
TRD260918T17		280,000.00	289,816.80	0.04
TOPLAM		690,000.00	692,498.30	0.09
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
TRT230222T13		41,176.00	70,078.71	0.01
TRT230222T13		4,663,975.00	8,012,000.00	1.05
TRT230222T13		17,352,941.00	29,544,783.42	3.85
TOPLAM		22,058,092.00	37,626,862.13	4.91
L) DİĞER	:			
Vadeli Mevduat gün 32		11,500,000.00	11,545,985.60	1.51
Vadeli Mevduat gün 32		11,500,000.00	11,545,985.60	1.51
Vadeli Mevduat gün 45		9,500,000.00	9,640,748.99	1.26
Vadeli Mevduat gün 45		17,000,000.00	17,257,682.42	2.25
BPP		20,029,260.26	20,029,260.26	2.61
BPP		15,022,130.13	15,022,130.13	1.96
BPP		10,015,041.10	10,015,041.10	1.31
TOPLAM			95,056,834.10	12.40
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	:	766,628,524.19		
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	8,123.40		
C. ALACAKLAR (+)	:	36,005.68		
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00		
E. BORÇLAR (-)	:	1,559,392.52		
FON TOPLAM DEĞERİ	:	765,113,260.75		

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER :

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	1,494,179.50
37002 Denetim Ücreti	657.30
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	291.57
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	15,791.21
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	18,898.53
37006 Saklama Giderleri	19,533.48
37008 Banka Masrafları	1,085.24
37010 Kap Gideri	262.35
370142 KYD Endeks Lisans Giderleri	1,486.80
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	7,186.37
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	14,448.95
37028 Portföy Saklama Hizmeti	2,772.00
37030 E-fatura Gideri	180.51
37098 Küsurat farkları	1.07
37099 Diğer Giderler	261.36
Toplam	1,577,036.24

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
TRFYKBK81846	01.08.2018	5000000.00
TRFTEBK81815	02.08.2018	10000000.00
TRFISMD81893	06.08.2018	5000000.00
TRT080818T12	08.08.2018	16400000.00
TRFGRFA81816	08.08.2018	5450000.00
TRFISMD818A0	08.08.2018	10000000.00
TRFFNBK81831	10.08.2018	7500000.00
TRFYKYM81810	10.08.2018	18000000.00
TRFAKFK81821	15.08.2018	15000000.00
TRFYKFK81813	16.08.2018	10000000.00
TRFFIBA81832	17.08.2018	8000000.00
TRFFNBK81849	17.08.2018	18100000.00
TRFYKBK81820	17.08.2018	10000000.00
TRFYKFK81821	27.08.2018	5000000.00
TRFFFKR81817	28.08.2018	4000000.00
TRFTCZB81825	29.08.2018	10000000.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR :