

YKP
(YOT) YAPI KREDİ PORTFOY ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
EKİM 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 PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	9,487,209.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	114,737,698.76
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	20,256,321.21
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	29.08.1996
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	5.664291
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	5.492196
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	3.13%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	8.20%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	10.38%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		46.49%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		39.04%
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		1.47%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		8.90%
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	4.09%
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	0.04%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	44.26%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	330.274
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	5,136,305.43
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	1,216,484.69

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT020322T17	1,200,000.00	951,516.00	0.83
TRT050220T17	700,000.00	603,057.00	0.52
TRT080328T15	1,100,000.00	866,580.00	0.75
TRT080720T19	27,000.00	23,069.34	0.02
TRT100719T18	25,000.00	23,577.50	0.02
TRT120820T12	13,000,000.00	13,595,010.00	11.83
TRT131119T19	4,300,000.00	4,194,521.00	3.65
TRT140623T19	5,500,000.00	5,286,105.00	4.60
TRT141118T19	2,000,000.00	2,070,460.00	1.80
TRT150120T16	7,800,000.00	7,150,416.00	6.22
TRT150519T15	7,800,000.00	7,770,906.00	6.76
TRT160119T18	1,338,000.00	1,275,595.68	1.11
TRT170221T12	1,900,000.00	1,563,795.00	1.36
TRT180123T10	2,000,000.00	1,646,560.00	1.43
TRT200219T11	5,500,000.00	9,085,395.00	7.90
TRT200324T13	600,000.00	444,216.00	0.39
TOPLAM	54,790,000.00	56,550,779.52	49.20
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			

TRFDFKT31912	1,000,000.00	1,041,610.00	0.91
TRFFFKR11921	1,500,000.00	1,423,530.00	1.24
TRFGRFA21911	2,000,000.00	1,865,080.00	1.62
TRFISFNK1866	1,730,000.00	1,700,711.10	1.48
TRFKFTF21918	1,440,000.00	1,378,929.60	1.20
TRFVFAS11919	1,000,000.00	959,070.00	0.83
TRFVKFK11915	510,000.00	481,475.70	0.42
TRFYKFK11919	1,050,000.00	994,623.00	0.87
TRFYKYMA1815	1,000,000.00	964,190.00	0.84
TOPLAM	11,230,000.00	10,809,219.40	9.40
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSAKFKK1910	1,500,000.00	1,972,170.00	1.72
TRSALJFK1813	1,000,000.00	1,066,780.00	0.93
TRSCLKM31910	2,100,000.00	2,154,558.00	1.87
TRSDOGH31910	1,130,000.00	1,066,720.00	0.93
TRSENSA72211	1,750,000.00	2,056,862.50	1.79
TRSGFYH31914	2,270,000.00	2,311,087.00	2.01
TRSIGYE1915	750,000.00	750,652.50	0.65
TRSKCTF32014	1,000,000.00	904,620.00	0.79
TRSKCTF41916	500,000.00	471,465.00	0.41
TRSKCTFA1812	1,000,000.00	1,051,160.00	0.91
TRSKCTY32015	100,000.00	107,037.00	0.09
TRSKFTF42016	1,300,000.00	1,305,785.00	1.14
TRSKFTFA1819	1,000,000.00	958,360.00	0.83
TRSKRSNE2018	1,000,000.00	1,000,490.00	0.87
TRSNLOG21912	1,100,000.00	1,168,618.00	1.02
TRSOPAS22111	1,500,000.00	1,546,395.00	1.35
TRSORFN72013	1,500,000.00	1,511,310.00	1.31
TRSOTKOK1815	145,000.00	152,505.20	0.13
TRSRNSHE1916	1,000,000.00	1,016,840.00	0.88
TRSSRTNA1817	1,100,000.00	1,142,482.00	0.99
TRSTATKK1816	130,000.00	131,159.60	0.11
TRSTBTF31910	800,000.00	728,640.00	0.63
TRSTBTF31928	510,000.00	461,437.80	0.40
TRSTHALE2716	500,000.00	509,575.00	0.44
TRSTIMG41917	550,000.00	561,907.50	0.49
TRSTISB72712	100,000.00	106,030.00	0.09
TRSVKFB92719	2,000,000.00	2,048,720.00	1.78
TRSZFKL21916	1,760,000.00	1,851,907.20	1.61
XS1629734879	2,350,000.00	2,044,464.75	1.78
TOPLAM	31,445,000.00	32,159,739.05	27.98
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 55		2,400,000.00	2,409,987.49	2.10
Vadeli Mevduat gün 55		2,200,000.00	2,209,050.30	1.92
BPP		10,800,096.77	10,800,096.77	9.40
TOPLAM			15,419,134.56	13.42

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	:	114,938,872.53
B. HAZİR DEĞERLER (+)	:	8,656.96
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	209,830.73
FON TOPLAM DEĞERİ	:	114,737,698.76

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER :

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	193,906.61
37002 Denetim Ücreti	833.28
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	415.83
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	310.80
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	2,277.62
37006 Saklama Giderleri	2,655.89
37008 Banka Masrafları	531.30
37010 Kap Gideri	239.94
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	7,519.52
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	1,967.44
37028 Portföy Saklama Hizmeti	2,483.25
37030 E-fatura Gideri	76.58
37098 Küsürat farkları	0.21
Toplam	213,218.27

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
TRFYKFKE1824	03.10.2018	1500000.00

TRSKCTYE1815	10.10.2018	890000.00
TRSICICE1818	12.10.2018	148000.00
TRSICICE1818	12.10.2018	740000.00
TRFOYMDE1812	16.10.2018	600000.00
TRFYKFKE1832	16.10.2018	2000000.00
TRFFFKRE1820	17.10.2018	1500000.00
TRFVKFKE1819	17.10.2018	1400000.00
TRFYKYME1829	17.10.2018	1000000.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR :