

YKP
(YHT) YAPI KREDİ PORTFOY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
MART 2019 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	:	463,795,050.51
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	7,023,806,389.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	31.07.2002
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.066032
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.065037
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.53%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	4.80%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	18.61%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		10.17%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		73.58%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		0.48%
Kira Sertifikası-Kamu-YP		0.00%
Kira Sertifikası-Özel Sektör-TL		0.06%
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		12.29%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		0.17%
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	0.53%
Vadeli_YP	2.16%
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	0.55%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	17.44%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	61.78%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	66.906
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	616,257,603.16
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	455,550,248.73

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT050220T17	100,000.00	89,729.00	0.02
TRT120820T12	500,000.00	521,870.00	0.11
TRT131119T19	300,000.00	297,459.00	0.06
TRT150519T15	11,800,000.00	12,115,650.00	2.61
TOPLAM	12,700,000.00	13,024,708.00	2.80
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFAKBK41972	25,000,000.00	24,860,500.00	5.35
TRFAKBK51955	15,000,000.00	14,638,050.00	3.15
TRFAKFK41916	11,700,000.00	11,686,779.00	2.51
TRFAKFK41924	10,000,000.00	9,843,600.00	2.12
TRFAKFK41932	4,500,000.00	4,454,460.00	0.96
TRFALNF61924	1,800,000.00	1,720,098.00	0.37
TRFDFKT81917	2,000,000.00	1,820,900.00	0.39
TRFFNBK41934	3,000,000.00	2,968,830.00	0.64
TRFFNBK41959	5,000,000.00	4,928,000.00	1.06
TRFFNBK51925	5,000,000.00	4,889,650.00	1.05
TRFFNBK51990	15,000,000.00	14,505,450.00	3.12
TRFFNBK71915	18,000,000.00	16,930,980.00	3.64

TRFGRFA41927	2,000,000.00	1,979,760.00	0.43
TRFGRFA41935	5,000,000.00	4,991,350.00	1.07
TRFGRFA51918	8,490,000.00	8,339,217.60	1.79
TRFGRFK61916	15,000,000.00	14,402,850.00	3.10
TRFHALK51919	10,000,000.00	9,712,900.00	2.09
TRHFHAS41915	10,000,000.00	9,902,400.00	2.13
TRFHLFK51918	5,000,000.00	4,886,550.00	1.05
TRFISFA41921	2,190,000.00	2,164,223.70	0.47
TRFISFA51912	10,000,000.00	9,720,300.00	2.09
TRFISFN41957	6,500,000.00	6,441,565.00	1.39
TRFISFN51915	10,750,000.00	10,517,477.50	2.26
TRFISFN51923	9,000,000.00	8,708,850.00	1.87
TRFISFN71913	15,000,000.00	14,085,000.00	3.03
TRFISFN71921	6,850,000.00	6,431,465.00	1.38
TRFISMD41970	5,000,000.00	4,979,750.00	1.07
TRFISMD419A7	5,000,000.00	4,968,500.00	1.07
TRFISMD419N0	3,900,000.00	3,845,400.00	0.83
TRFISMD519B2	10,000,000.00	9,805,100.00	2.11
TRFKCTY41914	3,250,000.00	3,243,012.50	0.70
TRFOTKO41910	5,880,000.00	5,807,911.20	1.25
TRFVFAS61914	15,000,000.00	14,261,700.00	3.07
TRFYAKF41917	4,000,000.00	3,965,600.00	0.85
TRFYKBK41915	13,500,000.00	13,415,085.00	2.88
TRFYKFK41924	10,000,000.00	9,904,400.00	2.13
TRFYKFK51915	3,200,000.00	3,139,456.00	0.68
TRFYKYM41921	6,000,000.00	5,946,000.00	1.28
TRFYKYM51912	6,000,000.00	5,827,380.00	1.25
TOPLAM	322,510,000.00	314,640,500.50	67.65
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSARCL22117	3,000,000.00	3,090,690.00	0.66
TRSAYGZE1914	2,600,000.00	2,762,526.00	0.59
TRISISGY32111	4,550,000.00	4,493,079.50	0.97
TRSKCTF32014	1,000,000.00	948,250.00	0.20
TRSKFTF42016	4,200,000.00	4,236,414.00	0.91
TRSOPAS22111	9,300,000.00	9,355,893.00	2.01
TRSOPAS42010	5,000,000.00	5,341,050.00	1.15
TRSOTKO32110	5,000,000.00	5,046,450.00	1.09
TRSOTKO81919	6,150,000.00	6,062,301.00	1.30
TRSRNSH22023	5,000,000.00	5,126,750.00	1.10
TRSTISB72712	5,000,000.00	5,141,850.00	1.11
TRSVKFB92719	5,000,000.00	5,032,850.00	1.08
TOPLAM	55,800,000.00	56,638,103.50	12.18
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
TRD100221T17	860,000.00	879,513.40	0.19
TRD120220T16	990,000.00	978,357.60	0.21
TRD140721T18	830,000.00	720,780.30	0.15
TRD181120T19	510,000.00	550,463.40	0.12

TRD220921T16	610,000.00	857,135.40	0.18
TRD230920T24	1,000,000.00	1,096,810.00	0.24
TRDHVKA41914	30,000.00	32,180.10	0.01
TRDHVKA41922	10,000.00	10,667.10	0.00
TRDZKBV41914	80,000.00	84,685.60	0.02
TOPLAM	4,920,000.00	5,210,592.90	1.12
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TRT010420T19	8,095,537.00	18,538,758.77	3.99
TRT020823T11	1,157,185.00	2,004,190.14	0.43
TRT030523T13	17,880,310.00	28,058,661.91	6.03
TRT150120T16	187,052.00	175,346.64	0.04
TRT150120T16	8,550,938.00	8,016,760.54	1.72
TOPLAM	35,871,022.00	56,793,718.00	12.21
L) DİĞER	:		
Forward EURO/TL	-2,000,000.00		
Vadeli Mevduat YP gün 38	2,000,000.00	12,641,233.18	2.72
Vadeli Mevduat gün 35	3,000,000.00	3,018,410.71	0.65
TOPLAM		15,659,643.89	3.37
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
O) VDMK	:		
TRPKYVFA2318	3,000,000.00	3,117,990.00	0.67
TOPLAM	3,000,000.00	3,117,990.00	0.67
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU	:		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	465,085,256.79	
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	38,127.72	
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00	
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00	
E. BORÇLAR (-)	:	1,328,334.00	
FON TOPLAM DEĞERİ	:	463,795,050.51	
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	:		
Açıklama		Tutarı	
37001 Fon Yönetim Ücreti		1,165,819.96	
37002 Denetim Ücreti		788.44	
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı		2,269.84	
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı		19,909.83	
37005 Vergi, Resim ve Harçlar		1,148.70	
37006 Saklama Giderleri		15,606.07	
37008 Banka Masrafları		1,551.16	

37010	Kap Gideri	264.43
37015	Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	7.53
37021	Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	9,777.05
37028	Portföy Saklama Hizmeti	4,504.50
37030	E-fatura Gideri	118.00
37099	Diğer Giderler	146.94
Toplam		1,221,912.45

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
TRFDFKT31912	01.03.2019	3500000.00
TRFAKFK31925	05.03.2019	4500000.00
TRFFNBK31935	08.03.2019	8000000.00
TRFISMD31955	11.03.2019	10000000.00
TRFFFKR31929	12.03.2019	3000000.00
TRFISFN31917	12.03.2019	7450000.00
TRFISMD31997	14.03.2019	15000000.00
TRSCLKM31910	15.03.2019	300000.00
TRFISFN31925	19.03.2019	6850000.00
TRFISMD319F8	21.03.2019	10000000.00
TRFISMD319G6	22.03.2019	10000000.00
TRSGFYH31914	25.03.2019	4530000.00
TRDKTSK31915	26.03.2019	20000.00
TRT270319T13	27.03.2019	20700000.00
TRT270319T13	27.03.2019	5000000.00
TRFAKYM31914	28.03.2019	10000000.00
TRFAKYM31914	28.03.2019	10000000.00
TRFAKYM31922	29.03.2019	9500000.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR :

10- ÖDÜNÇ İŞLEMLER :

A) ÖDÜNÇ VERİLEN :

Sermaye Piyasası Aracı	Menkul Kıymet	Nominal	Vade Tarihi	Cari Piyasa Değeri
------------------------	---------------	---------	-------------	--------------------

B) ÖDÜNÇ ALINAN :

Sermaye Piyasası Aracı	Menkul Kıymet	Nominal	Vade Tarihi	Cari Piyasa Değeri
------------------------	---------------	---------	-------------	--------------------