

YKP**(YBP) YAPI KREDİ PORTFOY PY BİRİNCİ DEĞİŞKEN ÖZEL FON****MART 2018 AYLIK RAPORUDUR.****1- FONU TANITICI BİLGİLER**

A. FONUN ADI	:	(YBP) YAPI KREDİ PORTFOY PY BİRİNCİ DEĞİŞKEN ÖZEL FON
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	30,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	94,283,828.75
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	105,789,750.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	10.08.1998
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.891238
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.877289
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.59%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	2.21%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	9.83%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		33.73%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		10.01%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		3.76%
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		0.02%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		6.51%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		45.96%
Yabancı Hisse Senetleri		0.00%
VIOP Nakit Teminat		0.00%

Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	0.00%
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	0.21%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	69.16%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	1382.994
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	0.00
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	0.00

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT010420T19	35,000.00	68,598.25	0.08
TRT050220T17	3,000,000.00	2,739,840.00	3.10
TRT110226T13	3,000,000.00	2,782,890.00	3.15
TRT110827T16	12,069,000.00	11,076,083.37	12.53
TRT131119T19	4,200,000.00	4,369,428.00	4.94
TRT140922T17	14,000.00	12,032.72	0.01
TRT150519T15	100,000.00	101,433.00	0.11
TRT170221T12	9,500,000.00	8,971,990.00	10.15
TRT170822T15	5,000,000.00	4,669,650.00	5.28
TRT180123T10	3,000,000.00	2,997,750.00	3.39
TRT240724T15	27,000.00	23,673.87	0.03
TRT270923T11	10,000.00	8,917.10	0.01
TOPLAM	39,955,000.00	37,822,286.31	42.80
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ			
TRSAKYP41612	428,128.00	450,138.06	0.51
TR SAYGZ12024	1,000,000.00	1,026,710.00	1.16
TR SICICE1818	555,000.00	577,533.00	0.65
TR SISGY32111	910,000.00	912,320.50	1.03

TRSKCTY32015	160,000.00	158,076.80	0.18
TRSOTKOK1815	650,000.00	668,798.00	0.76
TRSTIMG41917	900,000.00	938,304.00	1.06
TRSTIMGE1918	110,000.00	114,625.50	0.13
TRSTISB72712	1,580,000.00	1,623,544.80	1.84
TRSTTRK42012	500,000.00	521,075.00	0.59
TRSVKFB92719	2,080,000.00	2,092,875.20	2.37
TOPLAM	8,873,128.00	9,084,000.86	10.28
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
TRD220921T16	2,970,000.00	3,482,176.50	3.94
TOPLAM	2,970,000.00	3,482,176.50	3.94
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
US900123AL40	1100000.00	6590832.57	7.46
US900123AW05	750000.00	3322866.07	3.76
US900123BA75	18000.00	73486.98	0.08
US900123BD15	1801000.00	7377280.90	8.35
US900123BH29	1362000.00	5574310.09	6.31
US900123CG37	1000000.00	3947833.80	4.47
US900123CJ75	1400000.00	5156698.71	5.84
US900123CL22	1000000.00	4009871.02	4.54
US900123CM05	400000.00	1440313.89	1.63
TOPLAM	8,831,000.00	37,493,494.01	42.43
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
L) DİĞER	:		
Forward USD/TL	-1,500,000.00		
BPP	482,604.15	482,604.15	0.55
TOPLAM		482,604.15	0.55
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	:	88,364,561.83	
B. HAZİR DEĞERLER (+)	:	155,468.37	
C. ALACAKLAR (+)	:	6,232,022.59	
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00	
E. BORÇLAR (-)	:	18,085.98	
FON TOPLAM DEĞERİ	:	94,283,828.75	
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	:		
Açıklama		Tutarı	

37001	Fon Yönetim Ücreti	8,176.26
37002	Denetim Ücreti	454.40
370031	SGMK Tahvil Borsa Payı	634.91
370032	O/N RRP Tahvil Borsa Payı	4.97
37005	Vergi, Resim ve Harçlar	685.71
37006	Saklama Giderleri	1,882.34
37008	Banka Masrafları	403.70
37010	Kap Gideri	254.40
37015	Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	4,451.13
37021	Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	1,010.19
37028	Portföy Saklama Hizmeti	2,261.00
37030	E-fatura Gideri	175.04
37099	Diğer Giderler	253.44
	Toplam	20,647.49

6- GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI
KULLANIMI, BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM, TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA
İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

Açıklama : Giriş Tarihi Stok Kazanılan Nominal

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR :

8- İTFALAR :

Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal
TRSLMAK31815	22.03.2018	900000.00
TRSAYGZ31818	26.03.2018	375000.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR :