

YKP
(YHT) YAPI KREDİ PORTFOY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
EYLÜL 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	:	582,422,348.74
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	9,792,953,261.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	31.07.2002
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.059474
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.058820
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.11%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	9.94%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	13.00%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		5.94%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		78.27%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		0.09%
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		5.52%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		3.32%
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	6.85%
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	24.14%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	36.37%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	49.592
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	628,124,342.38
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	437,736,378.12

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT141118T19	3,000,000.00	3,040,920.00	0.52
TRT150519T15	4,000,000.00	3,859,720.00	0.66
TRT160119T18	5,738,000.00	5,333,184.10	0.91
TRT200219T11	10,000,000.00	15,762,200.00	2.70
TOPLAM	22,738,000.00	27,996,024.10	4.80
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFAKBKK1828	35,000,000.00	34,328,350.00	5.88
TRFAKBKK1836	10,000,000.00	9,686,900.00	1.66
TRFAKFK11919	10,000,000.00	9,277,500.00	1.59
TRFAKFKK1816	5,700,000.00	5,518,227.00	0.95
TRFDFKT31912	3,500,000.00	3,564,260.00	0.61
TRFFFKR11913	3,000,000.00	2,757,030.00	0.47
TRFFIBAE1827	10,000,000.00	9,954,400.00	1.71
TRFFIBAK1837	6,680,000.00	6,529,499.60	1.12
TRFFNBKE18A7	8,000,000.00	7,943,440.00	1.36
TRFFNBKK1838	3,000,000.00	2,950,350.00	0.51
TRFFNBKK1846	5,000,000.00	4,881,500.00	0.84
TRFGRANE1839	2,000,000.00	1,991,760.00	0.34

TRFGRFA21911	5,000,000.00	4,684,200.00	0.80
TRFGRFAK1815	16,200,000.00	15,925,572.00	2.73
TRFGRFKK1813	4,550,000.00	4,492,806.50	0.77
TRFHALKE1811	10,000,000.00	9,916,200.00	1.70
TRFHALKE1829	10,000,000.00	9,885,900.00	1.69
TRFHLFKK1818	5,000,000.00	4,904,900.00	0.84
TRFISFAA1814	11,500,000.00	11,050,005.00	1.89
TRFISFAK1812	3,750,000.00	3,667,125.00	0.63
TRFISFN11927	6,590,000.00	6,062,800.00	1.04
TRFISFNE1815	15,840,000.00	15,750,504.00	2.70
TRFISFNK1817	6,000,000.00	5,922,660.00	1.01
TRFISFNK1833	10,000,000.00	9,743,000.00	1.67
TRFISMDA1812	5,000,000.00	4,795,100.00	0.82
TRFISMDE1826	5,000,000.00	4,943,750.00	0.85
TRFISMDE1891	3,400,000.00	3,386,230.00	0.58
TRFISMDE18A2	6,820,000.00	6,749,413.00	1.16
TRFSKBKE1818	10,000,000.00	9,955,500.00	1.71
TRFTCZBE1810	20,000,000.00	19,959,400.00	3.42
TRFTEBKE1815	20,000,000.00	19,969,400.00	3.42
TRFTEBKE1831	10,000,000.00	9,949,400.00	1.70
TRFTEBKE1849	15,000,000.00	14,829,900.00	2.54
TRFTEBKK1817	10,000,000.00	9,842,800.00	1.69
TRFTHALE1812	5,000,000.00	4,989,950.00	0.85
TRFTHALE1838	20,000,000.00	19,667,000.00	3.37
TRFVFAS11919	10,000,000.00	9,432,700.00	1.62
TRFVKFBK1838	10,000,000.00	9,802,300.00	1.68
TRFVKFKE1819	4,770,000.00	4,713,523.20	0.81
TRFYKBKE1844	5,000,000.00	4,923,900.00	0.84
TRFYKBKK1820	10,000,000.00	9,766,600.00	1.67
TRFYKFKE1816	4,000,000.00	3,961,080.00	0.68
TRFYKFKE1824	10,000,000.00	9,990,700.00	1.71
TRFYKFKE1832	5,000,000.00	4,951,900.00	0.85
TRFYKFKK1826	5,000,000.00	4,883,500.00	0.84
TRFYKME1811	15,000,000.00	14,938,500.00	2.56
TRFYKME1829	5,000,000.00	4,958,950.00	0.85
TRFYKMK1813	13,000,000.00	12,711,920.00	2.18
TOPLAM	433,300,000.00	425,462,305.30	72.90
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSGFYH31914	4,530,000.00	4,571,041.80	0.78
TRSIGY32111	4,550,000.00	4,572,977.50	0.78
TRSKFTF42016	4,200,000.00	4,144,686.00	0.71
TRSOPAS22111	9,000,000.00	9,085,050.00	1.56
TRSOPAS42010	5,000,000.00	5,341,200.00	0.92
TRSRNSH22023	5,000,000.00	5,172,700.00	0.89
TRSTISB72712	5,000,000.00	5,201,100.00	0.89
TRSVKFB92719	5,000,000.00	5,010,300.00	0.86
TOPLAM	42,280,000.00	43,099,055.30	7.38
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		

H) KİRA SERTİFİKALARI	:			
TRD130219T18		410,000.00	411,467.80	0.07
TOPLAM		410,000.00	411,467.80	0.07
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
TRT230222T13		154,287.00	270,356.40	0.05
TRT230222T13		22,000,000.00	38,573,413.70	6.61
TOPLAM		22,154,287.00	38,843,770.10	6.66
L) DİĞER	:			
Vadeli Mevduat gün 36		7,000,000.00	7,063,164.90	1.21
Vadeli Mevduat gün 36		9,500,000.00	9,583,619.40	1.64
Vadeli Mevduat gün 36		10,000,000.00	10,088,463.55	1.73
BPP		5,122,089.04	5,069,299.45	0.87
BPP		1,847,872.40	1,847,872.40	0.32
BPP		5,166,848.79	5,166,848.79	0.89
BPP		9,088,150.68	9,020,266.27	1.55
TOPLAM			47,839,534.76	8.20
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	:	583,652,157.36		
B. HAZİR DEĞERLER (+)	:	9,361.28		
C. ALACAKLAR (+)	:	49,572.35		
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00		
E. BORÇLAR (-)	:	1,288,742.25		
FON TOPLAM DEĞERİ	:	582,422,348.74		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	:			
Açıklama			Tutarı	
37001 Fon Yönetim Ücreti		1,135,516.65		
37002 Denetim Ücreti		708.40		
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı		2,093.38		
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı		10,016.19		
37005 Vergi, Resim ve Harçlar		4,029.36		
37006 Saklama Giderleri		16,173.03		
37008 Banka Masrafları		1,071.18		
37010 Kap Gideri		222.60		
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu		14,918.41		
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti		249.81		
37028 Portföy Saklama Hizmeti		2,016.00		

37030	E-fatura Gideri	153.16
37099	Diğer Giderler	221.76
Toplam		1,187,389.93

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
TRFISFA91819	04.09.2018	11500000.00
TRFFIBA91815	05.09.2018	3140000.00
TRFGRAN91819	05.09.2018	20000000.00
TRFGRAN91819	05.09.2018	500000.00
TRFDFKT91817	06.09.2018	2900000.00
TRFISFN91838	07.09.2018	2590000.00
TRFYKBK91811	07.09.2018	10000000.00
TRFISFN91812	11.09.2018	12000000.00
TRFFIBA91823	12.09.2018	3000000.00
TRFGRAN91884	14.09.2018	10000000.00
TRFHLGY91814	19.09.2018	8250000.00
TRFFNBK91830	21.09.2018	6700000.00
TRFISFN91820	21.09.2018	10000000.00
TRFVKFB91833	21.09.2018	10000000.00
TRD260918T17	26.09.2018	280000.00
TRFAKYM91819	27.09.2018	11600000.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR :