

YKP
(YHT) YAPI KREDİ PORTFOY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
EKİM 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	:	517,443,226.61
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	8,536,427,575.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	31.07.2002
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.060616
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.059474
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.92%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	12.05%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	14.18%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		10.24%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		73.31%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		0.07%
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		8.97%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		2.57%
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	4.84%
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	18.43%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	73.41%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	51.314
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	445,864,396.16
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	370,411,578.94

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT050220T17	100,000.00	86,151.00	0.02
TRT100719T18	12,900,000.00	12,165,990.00	2.41
TRT141118T19	7,020,000.00	7,267,314.60	1.44
TRT150519T15	10,600,000.00	10,560,462.00	2.09
TRT160119T18	5,838,000.00	5,565,715.68	1.10
TRT200219T11	10,000,000.00	16,518,900.00	3.27
TRT270319T13	1,000,000.00	960,600.00	0.19
TOPLAM	47,458,000.00	53,125,133.28	10.51
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
TRT100719T18	-12,900,000.00	-12,148,317.00	-2.40
TRT270319T13	-1,000,000.00	-960,290.00	-0.19
TOPLAM	-13,900,000.00	-13,108,607.00	-2.59
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFAKBKK1828	35,000,000.00	34,875,400.00	6.90
TRFAKBKK1836	10,000,000.00	9,879,800.00	1.96
TRFAKFK11919	10,000,000.00	9,483,200.00	1.88
TRFAKFK11927	10,000,000.00	9,467,000.00	1.87
TRFAKFKK1816	5,700,000.00	5,645,679.00	1.12
TRFDFKT31912	3,500,000.00	3,645,635.00	0.72

TRFFFKR11913	3,000,000.00	2,813,670.00	0.56
TRFFIBAA1821	19,500,000.00	18,905,055.00	3.74
TRFFIBAK1837	6,680,000.00	6,635,177.20	1.31
TRFFNBKA1822	8,000,000.00	7,748,480.00	1.53
TRFFNBKK1838	3,000,000.00	2,998,440.00	0.59
TRFFNBKK1846	5,000,000.00	4,961,050.00	0.98
TRFGRFA21911	5,000,000.00	4,662,700.00	0.92
TRFGRFAK1815	16,200,000.00	16,127,586.00	3.19
TRFGRFKK1813	4,550,000.00	4,546,678.50	0.90
TRFHFAS11918	10,000,000.00	9,424,500.00	1.86
TRFHFAS21917	10,000,000.00	9,204,900.00	1.82
TRFHLLFK11912	5,000,000.00	4,738,050.00	0.94
TRFHLLFKK1818	5,000,000.00	4,984,450.00	0.99
TRFISFA11916	8,600,000.00	8,161,486.00	1.62
TRFISFAA1814	11,500,000.00	11,269,195.00	2.23
TRFISFAK1812	3,750,000.00	3,728,100.00	0.74
TRFISFN11927	6,590,000.00	6,199,410.70	1.23
TRFISFN11935	10,830,000.00	10,266,623.40	2.03
TRFISFN11943	5,530,000.00	5,186,421.10	1.03
TRFISFNK1817	6,000,000.00	5,997,540.00	1.19
TRFISFNK1833	10,000,000.00	9,932,000.00	1.97
TRFISMDA1812	5,000,000.00	4,831,700.00	0.96
TRFKCTY41914	3,250,000.00	2,871,732.50	0.57
TRFOTKO41910	5,880,000.00	5,169,225.60	1.02
TRFTCZBA1822	15,000,000.00	14,467,350.00	2.86
TRFTEBKK1817	10,000,000.00	10,000,000.00	1.98
TRFTHAL11922	20,000,000.00	18,823,400.00	3.72
TRFVFAS11919	10,000,000.00	9,590,700.00	1.90
TRFVKFBK1838	10,000,000.00	9,941,700.00	1.97
TRFVKFK11915	3,080,000.00	2,907,735.60	0.58
TRFYKBK11926	10,000,000.00	9,415,900.00	1.86
TRFYKBKK1820	10,000,000.00	9,961,800.00	1.97
TRFYKFK11919	5,240,000.00	4,963,642.40	0.98
TRFYKFK11927	5,000,000.00	4,713,050.00	0.93
TRFYKFKK1826	5,000,000.00	4,978,350.00	0.99
TRFYKYMA1815	5,000,000.00	4,820,950.00	0.95
TRFYKYMK1813	13,000,000.00	12,919,010.00	2.56
TOPLAM	373,380,000.00	361,864,473.00	71.61
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSAYGZE1914	2,600,000.00	2,612,532.00	0.52
TRSGFYH31914	4,530,000.00	4,611,993.00	0.91
TRSIGY32111	4,550,000.00	4,670,893.50	0.92
TRSKFTF42016	4,200,000.00	4,218,690.00	0.83
TRSOPAS22111	9,000,000.00	9,278,370.00	1.84
TRSOPAS42010	5,000,000.00	5,018,450.00	0.99
TRSRNSH22023	5,000,000.00	5,267,750.00	1.04
TRSTISB72712	5,000,000.00	5,301,500.00	1.05
TRSVKFB92719	5,000,000.00	5,121,800.00	1.01

TOPLAM		44,880,000.00	46,101,978.50	9.12
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
H) KİRA SERTİFİKALARI	:			
TRD130219T18		410,000.00	409,540.80	0.08
TOPLAM		410,000.00	409,540.80	0.08
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
TRT141118T19		249,504.00	259,119.35	0.05
TRT141118T19		53,947.00	56,025.81	0.01
TRT141118T19		24,083,390.00	25,015,671.25	4.95
TOPLAM		24,386,841.00	25,330,816.41	5.01
L) DİĞER	:			
Vadeli Mevduat gün 55		10,000,000.00	10,041,217.21	1.99
Vadeli Mevduat gün 55		7,000,000.00	7,029,130.18	1.39
Vadeli Mevduat gün 55		9,500,000.00	9,539,080.86	1.89
BPP		5,003,267.12	5,003,267.12	0.99
TOPLAM			31,612,695.37	6.26
M) VARANT	:			
N) VİOP NAKİT TEMİNAT	:			
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
O) VDMK	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU	:			
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	505,336,030.36		
B. HAZİR DEĞERLER (+)	:	11,270.73		
C. ALACAKLAR (+)	:	24,445,785.65		
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00		
E. BORÇLAR (-)	:	12,349,860.13		
FON TOPLAM DEĞERİ	:	517,443,226.61		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	:			
Açıklama		Tutarı		
37001 Fon Yönetim Ücreti		983,380.26		
37002 Denetim Ücreti		784.30		
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı		1,859.28		
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı		13,896.89		
37005 Vergi, Resim ve Harçlar		4,391.98		
37006 Saklama Giderleri		26,707.76		
37008 Banka Masrafları		1,449.00		
37010 Kap Gideri		246.45		
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu		6,433.56		
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti		9,509.15		
37028 Portföy Saklama Hizmeti		2,772.00		

37030	E-fatura Gideri	76.58
37098	Küsürat farkları	6.59
37099	Diğer Giderler	245.52
Toplam		1,051,759.32

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	10000000.00
TRFTEBKE1815	04.10.2018	20000000.00
TRFTCZBE1810	05.10.2018	20000000.00
TRFTHALE1812	05.10.2018	5000000.00
TRFSKBKE1818	08.10.2018	10000000.00
TRFGRANE1839	09.10.2018	2000000.00
TRFISMDE1891	09.10.2018	3400000.00
TRFYKYME1811	09.10.2018	15000000.00
TRFFIBAE1827	10.10.2018	10000000.00
TRFTEBKE1831	11.10.2018	10000000.00
TRFFNBKE18A7	12.10.2018	8000000.00
TRFISFNE1815	12.10.2018	15840000.00
TRFYKFKE1832	16.10.2018	5000000.00
TRFHALKE1811	17.10.2018	10000000.00
TRFVKFKE1819	17.10.2018	4770000.00
TRFYKYME1829	17.10.2018	5000000.00
TRFISMDE18A2	18.10.2018	6820000.00
TRFTEBKE1849	18.10.2018	15000000.00
TRFHALKE1829	23.10.2018	10000000.00
TRFISMDE1826	25.10.2018	5000000.00
TRFTHALE1838	26.10.2018	20000000.00
TRFYKFKE1816	26.10.2018	4000000.00
TRFYKBKE1844	31.10.2018	5000000.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR :