

YKP
(YDP) YAPI KREDİ PORTFOY PY ÜÇÜNCÜ DEĞİSKEN ÖZEL FON
KASIM 2018 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	(YDP) YAPI KREDİ PORTFOY PY ÜÇÜNCÜ DEĞİSKEN ÖZEL FON
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFOY YONETİMİ AS
Ç. FON TUTARI	:	300,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	472,904,158.55
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	24,002,278,831.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	20.07.2012
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.019702
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.019048
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	3.43%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	16.04%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	18.20%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		7.17%
Devlet Tahvili		40.26%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		30.65%
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		2.28%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		7.78%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.00%
Yabancı Hisse Senetleri		0.00%
VIOP Nakit Teminat		1.77%

Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	2.40%
Vadeli_YP	2.08%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	5.59%
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	47.92%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	24.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	24.50%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	408.702
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	0.00
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	3,674,999.98

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
AKBNK	330,000.00	2,527,800.00	0.54
ARCLK	62,500.00	977,500.00	0.21
ASELS	105,000.00	2,803,500.00	0.59
BIMAS	33,500.00	2,830,750.00	0.60
ENKAI	0.54	2.55	0.00
EREGL	225,000.00	1,707,750.00	0.36
GARAN	350,000.00	2,894,500.00	0.61
ISCTR	375,000.00	1,597,500.00	0.34
ISDMR	92,419.00	560,059.14	0.12
ISGYO	1.08	1.08	0.00
KAREL	80.00	348.00	0.00
KCHOL	175,000.00	2,691,500.00	0.57
KORDS	57,000.00	577,410.00	0.12
MGROS	87,500.00	1,370,250.00	0.29
ODAS	0.58	1.48	0.00
OTKAR	4,900.00	417,970.00	0.09
PGSUS	85,000.00	2,150,500.00	0.46
SISE	0.53	2.68	0.00
SODA	0.02	0.12	0.00
TCELL	178,145.00	2,260,660.05	0.48
THYAO	112,500.00	1,912,500.00	0.40
TKFEN	32,500.00	651,300.00	0.14
TOASO	25,000.00	485,000.00	0.10

TTKOM	350,000.00	1,368,500.00	0.29
TUPRS	21,750.00	2,716,575.00	0.58
VAKBN	450,001.00	1,804,504.01	0.38
YKBNK	500,000.32	865,000.55	0.18
TOPLAM	3,652,798.07	35,171,384.65	7.45
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI	:		
TRT050220T17	14,800,000.00	13,477,472.00	2.85
TRT080328T15	9,100,000.00	7,770,217.00	1.64
TRT100719T18	6,000,000.00	5,837,220.00	1.24
TRT110827T16	269,000.00	207,891.27	0.04
TRT120325T12	20,000.00	13,808.00	0.00
TRT120820T12	25,200,000.00	28,206,612.00	5.97
TRT131119T19	19,000,000.00	18,015,800.00	3.81
TRT140623T19	1,800,000.00	1,897,092.00	0.40
TRT150120T16	18,200,000.00	17,526,782.00	3.71
TRT150519T15	15,900,000.00	15,399,309.00	3.26
TRT170221T12	29,800,000.00	26,651,928.00	5.64
TRT170822T15	6,100,000.00	5,223,186.00	1.11
TRT180123T10	10,700,000.00	9,722,769.00	2.06
TRT200324T13	67,000.00	53,374.21	0.01
TRT220921T18	52,700,000.00	44,351,266.00	9.39
TRT240724T15	22,000.00	16,648.94	0.00
TOPLAM	209,678,000.00	194,371,375.42	41.14
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ	:		
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)	:		
E) DÖVİZE ENDEKSİLİ TAHVİLLER	:		
F) FİNANSMAN BONOLARI	:		
TRFAKBK21917	8,000,000.00	7,633,920.00	1.62
TRFAKFKA1826	4,475,000.00	4,467,974.25	0.95
TRFAKYMA1821	10,000,000.00	9,869,500.00	2.09
TRFFFKR11921	2,200,000.00	2,139,896.00	0.45
TRFFNBK11952	3,000,000.00	2,892,930.00	0.61
TRFGRFA11912	2,150,000.00	2,078,018.00	0.44
TRFHLEFK11912	3,000,000.00	2,914,680.00	0.62
TRFISFA11916	4,590,000.00	4,483,007.10	0.95
TRFISFA11924	3,020,000.00	2,920,340.00	0.62
TRFISFN11927	2,470,000.00	2,377,671.40	0.50
TRFISFN11943	5,530,000.00	5,341,261.10	1.13
TRFISFN31917	3,480,000.00	3,265,423.20	0.69
TRFISFN31933	13,660,000.00	12,665,688.60	2.68
TRFISFN41916	5,000,000.00	4,612,850.00	0.98
TRFKCTY41914	1,600,000.00	1,450,608.00	0.31
TRFKFTF21918	5,000,000.00	4,860,650.00	1.03
TRFVKFK11915	510,000.00	493,445.40	0.10
TRFYKFK11919	3,660,000.00	3,552,652.20	0.75
TRFYKFK11927	5,000,000.00	4,824,400.00	1.02
TRFYKFK51915	1,650,000.00	1,482,723.00	0.31
TRFYKYMA1815	10,000,000.00	9,879,200.00	2.09

TOPLAM	97,995,000.00	94,206,838.25	19.94
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TR SAYGZ12024	1,000,000.00	914,180.00	0.19
TR SCLKM31910	2,000,000.00	2,109,920.00	0.45
TR SENSEA72211	5,100,000.00	6,538,659.00	1.38
TR SGFYH31914	1,360,000.00	1,418,398.40	0.30
TR SKCTF11919	1,400,000.00	1,438,976.00	0.30
TR SKCTF32014	2,000,000.00	1,875,380.00	0.40
TR SKCTY62012	1,000,000.00	1,063,440.00	0.23
TR SKFTF42016	1,900,000.00	1,790,655.00	0.38
TR SKFTFA1819	500,000.00	491,185.00	0.10
TR SKRSNE2018	2,000,000.00	2,065,040.00	0.44
TR SOPAS22111	1,000,000.00	991,430.00	0.21
TR SOPAS42010	5,000,000.00	5,085,150.00	1.08
TR SORFN31910	2,400,000.00	2,265,312.00	0.48
TR SOTKO12013	5,000,000.00	5,359,700.00	1.13
TR STHALE2716	500,000.00	509,520.00	0.11
TR STIMGE1918	1,000,000.00	1,006,770.00	0.21
TR STISB72712	5,010,000.00	5,112,254.10	1.08
TR SVKFB92719	2,010,000.00	2,102,962.50	0.45
TR SZFKL21916	2,630,000.00	2,655,984.40	0.56
XS1629734879	2,350,000.00	2,155,807.75	0.46
TOPLAM	45,160,000.00	46,950,724.15	9.94
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
L) DİĞER	:		
Forward USD/TL	-1,800,000.00		
GLDTRf	1,250,000.00	22,933,750.00	4.85
YSP	8,227,000.00	2,199,973.84	0.47
YPL	400,000.00	2,097,207.50	0.44
Vadeli Mevduat YP gün 55	1,800,000.00	9,345,321.86	1.98
Vadeli Mevduat gün 55	11,000,000.00	11,289,755.72	2.39
F_USDTRY1218	2,750.00	14,516,150.00	
F_XAUUSD1218	1,500.00	9,441,177.75	
BPP	10,046,315.07	10,039,769.50	2.13
BPP	26,474,687.74	26,474,687.74	5.60
BPP	9,596,712.33	9,596,712.33	2.03
TOPLAM		93,977,178.49	19.89
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		
	7,728,654.37	7,728,654.37	1.64
TOPLAM	7,728,654.37	7,728,654.37	1.64
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:		

VALÖRLÜ İŞLEMLER :
O) VDMK :
VALÖRLÜ İŞLEMLER :

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU :

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	472,406,155.34
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	4,787.52
C. ALACAKLAR (+)	:	1,069,804.80
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	576,589.11
FON TOPLAM DEĞERİ	:	472,904,158.55

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER :

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	82,091.82
37002 Denetim Ücreti	809.28
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	487.75
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	1,957.20
37004 Aracılık Komisyonu	5,754.07
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	5,839.24
37006 Saklama Giderleri	8,968.80
37008 Banka Masrafları	646.50
37010 Kap Gideri	254.40
370141 İMKB Endeksi Lisans Sözleşmesi	1,239.00
370142 KYD Endeks Lisans Giderleri	1,858.50
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	16,997.53
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	8,298.77
37023 VIOP İşlemi Komisyonu	15,802.33
37028 Portföy Saklama Hizmeti	2,332.75
37099 Diğer Giderler	253.44
Toplam	153,591.38

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

Açıklama	Giriş Tarihi	Stok	Kazanılan Nominal
BIMAS Tem :%80.00	07.11.2018	36800.00	29440.00

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR :

8- İTFALAR :

Menkul Kıymet Türü	İtf Tarih	Nominal
TRFISMDK1877	02.11.2018	10000000.00
TRFYKFKK1818	08.11.2018	5000000.00
TRFFNBKK1820	09.11.2018	3000000.00
TRFAKBKK1836	20.11.2018	8000000.00
TRFISFNK1866	23.11.2018	12980000.00

TRFYKFKK1834	23.11.2018	6580000.00
TRSTATKK1816	27.11.2018	25000.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR :