

YKP
(YDP) YAPI KREDİ PORTFOY PY ÜÇÜNCÜ DEĞİSKEN ÖZEL FON
ARALIK 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	:	482,598,883.75
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	24,153,740,434.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	20.07.2012
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.019980
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.019702
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.41%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	17.68%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	17.68%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		6.52%
Devlet Tahvili		39.95%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		28.41%
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		6.86%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		4.74%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.00%
Yabancı Hisse Senetleri		0.00%
VIOP Nakit Teminat		1.72%

Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	3.25%
Vadeli_YP	2.10%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	5.49%
Katılma Belgesi YP	0.00%
CC Swap	0.00%
FX Swap	0.00%
IR Swap	0.00%
VDMK	0.96%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	48.10%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	14.82%
Devlet Borçlanma Senetleri	7.94%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	390.593
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	0.00
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	2,999,999.97

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
AKBNK	250,000.00	1,715,000.00	0.36
ARCLK	62,500.00	986,875.00	0.20
ASELS	70,000.00	1,685,600.00	0.35
BIMAS	28,000.00	2,436,000.00	0.50
ENKAI	0.54	2.49	0.00
EREGL	200,000.00	1,444,000.00	0.30
GARAN	275,000.00	2,189,000.00	0.45
ISCTR	200,000.00	906,000.00	0.19
ISDMR	60,000.00	339,600.00	0.07
ISGYO	1.08	1.16	0.00
KAREL	80.00	333.60	0.00
KCHOL	145,000.00	2,059,000.00	0.43
MGROS	87,500.00	1,303,750.00	0.27
ODAS	0.58	1.11	0.00
OTKAR	4,900.00	432,425.00	0.09
PGSUS	84,000.00	1,925,280.00	0.40
SISE	0.53	3.02	0.00
SODA	125,000.02	887,500.12	0.18
TAVHL	20,500.00	490,360.00	0.10
TCELL	178,145.00	2,168,024.65	0.45
THYAO	96,316.00	1,551,650.76	0.32
TKFEN	50,000.00	1,036,000.00	0.21
TOASO	25,000.00	422,500.00	0.09

TTKOM	350,000.00	1,365,000.00	0.28
TUPRS	19,000.00	2,217,300.00	0.46
VAKBN	450,001.00	1,755,003.90	0.36
YKBNK	425,000.32	680,000.51	0.14
TOPLAM	3,205,945.07	29,996,211.32	6.21
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI	:		
TRT050220T17	14,800,000.00	13,496,712.00	2.80
TRT080328T15	9,100,000.00	7,943,663.00	1.65
TRT100719T18	6,000,000.00	5,903,760.00	1.22
TRT110827T16	269,000.00	211,420.55	0.04
TRT120325T12	20,000.00	14,348.20	0.00
TRT120820T12	25,200,000.00	28,824,516.00	5.97
TRT131119T19	19,000,000.00	18,290,730.00	3.79
TRT140623T19	1,800,000.00	1,762,596.00	0.37
TRT150120T16	18,200,000.00	17,546,438.00	3.64
TRT150519T15	4,600,000.00	4,507,816.00	0.93
TRT170221T12	29,800,000.00	26,950,822.00	5.58
TRT170822T15	6,100,000.00	5,243,316.00	1.09
TRT180123T10	10,700,000.00	9,727,584.00	2.02
TRT200324T13	67,000.00	54,648.55	0.01
TRT220921T18	52,700,000.00	44,680,641.00	9.26
TRT240724T15	22,000.00	17,011.50	0.00
TOPLAM	198,378,000.00	185,176,022.80	38.36
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ	:		
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)	:		
E) DÖVİZE ENDEKSİLİ TAHVİLLER	:		
F) FİNANSMAN BONOLARI	:		
TRFAKBK21917	8,000,000.00	7,780,240.00	1.61
TRFFFKR11921	2,200,000.00	2,191,684.00	0.45
TRFFNBK11952	3,000,000.00	2,958,780.00	0.61
TRFGRFA11912	2,150,000.00	2,124,221.50	0.44
TRFHLFK11912	3,000,000.00	2,986,980.00	0.62
TRFISFA11916	4,590,000.00	4,575,357.90	0.95
TRFISFA11924	3,020,000.00	2,979,743.40	0.62
TRFISFN11927	2,470,000.00	2,434,185.00	0.50
TRFISFN11943	5,530,000.00	5,444,229.70	1.13
TRFISFN31917	3,480,000.00	3,340,660.80	0.69
TRFISFN31933	13,660,000.00	12,917,852.20	2.68
TRFISFN41916	5,000,000.00	4,704,450.00	0.97
TRFKCTY41914	1,600,000.00	1,497,584.00	0.31
TRFKFTF21918	5,000,000.00	4,929,850.00	1.02
TRFVKFK11915	510,000.00	505,843.50	0.10
TRFYKFK11919	3,660,000.00	3,639,540.60	0.75
TRFYKFK11927	5,000,000.00	4,943,550.00	1.02
TRFYKFK51915	1,650,000.00	1,528,428.00	0.32
TRFYKYM31914	10,000,000.00	9,524,200.00	1.97
TOPLAM	83,520,000.00	81,007,380.60	16.78
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		

G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:			
TRSAYGZ12024		1,000,000.00	935,640.00	0.19
TRSCMK31910		2,000,000.00	2,164,540.00	0.45
TRSENSA72211		5,100,000.00	6,577,776.00	1.36
TRSGFYH31914		1,360,000.00	1,355,525.60	0.28
TRSKCTF11919		1,400,000.00	1,474,900.00	0.31
TRSKCTF32014		2,000,000.00	1,910,520.00	0.40
TRSKCTY62012		1,000,000.00	1,007,160.00	0.21
TRSKFTF42016		1,900,000.00	1,821,568.00	0.38
TRSKRSNE2018		2,000,000.00	2,103,280.00	0.44
TRSOPAS22111		1,000,000.00	1,009,160.00	0.21
TRSOPAS42010		5,000,000.00	5,148,500.00	1.07
TRSORFN31910		2,400,000.00	2,304,144.00	0.48
TRSOTKO12013		5,000,000.00	5,452,050.00	1.13
TRSTHALE2716		500,000.00	505,850.00	0.10
TRSTIMGE1918		1,000,000.00	1,033,770.00	0.21
TRSTISB72712		5,010,000.00	5,182,845.00	1.07
TRSVKFB92719		2,010,000.00	1,996,332.00	0.41
TRSZFKL21916		2,630,000.00	2,692,672.90	0.56
XS1629734879		2,350,000.00	2,076,319.00	0.43
TOPLAM		44,660,000.00	46,752,552.50	9.69
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
H) KİRA SERTİFİKALARI	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
TRT020823T11		20,713,160.00	37,551,883.55	7.78
TOPLAM		20,713,160.00	37,551,883.55	7.78
L) DİĞER	:			
Forward EURO/TL		-1,700,000.00		
GLDTRf		1,250,000.00	24,645,000.00	5.11
YPL		400,000.00	2,201,397.52	0.46
Vadeli Mevduat YP gün 50		1,700,000.00	10,284,521.79	2.13
Vadeli Mevduat gün 50		10,000,000.00	10,082,719.90	2.09
Vadeli Mevduat gün 50		11,000,000.00	11,090,991.89	2.30
F_XAUUSD0219		750.00	5,101,842.08	
BPP		21,683,830.99	21,379,120.41	4.43
BPP		9,007,283.18	8,874,681.41	1.84
BPP		129,169.64	129,169.64	0.03
TOPLAM			88,687,602.57	18.37
M) VARANT	:			
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:			
		7,946,178.10	7,946,178.10	1.65
TOPLAM		7,946,178.10	7,946,178.10	1.65
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
O) VDMK	:			

TRPKYVFA2318	5,500,000.00	5,565,395.00	1.15
TOPLAM	5,500,000.00	5,565,395.00	1.15
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU :

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	482,683,226.43
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	5,058.71
C. ALACAKLAR (+)	:	42,732.05
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	132,133.44
FON TOPLAM DEĞERİ	:	482,598,883.75

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER :

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	78,422.36
37002 Denetim Ücreti	758.70
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	220.80
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	6,609.25
37004 Aracılık Komisyonu	3,422.36
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	9,971.10
37006 Saklama Giderleri	6,614.36
37008 Banka Masrafları	939.58
37009 Noter Tasdik ve Ücreti	98.66
37010 Kap Gideri	889.02
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	11,544.44
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	8,337.94
37023 VIOP İşlemi Komisyonu	19,608.72
37028 Portföy Saklama Hizmeti	2,107.00
37029 E-defter Gideri	621.69
37099 Diğer Giderler	237.60
Toplam	150,403.58

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

Açıklama	Giriş Tarihi	Stok	Kazanılan Nominal
ENKAI Tem :%4.00	12.12.2018	0.54	0.02
ASELS Tem :%2.47	13.12.2018	70000.00	1731.58
TCELL Tem :%28.79	17.12.2018	178145.00	51284.17

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR :

8- İTFALAR :

Menkul Kıymet Türü	İtf Tarih	Nominal
TRFAKFKA1826	05.12.2018	4475000.00
TRFYKYMA1815	19.12.2018	10000000.00
TRFAKYMA1821	21.12.2018	10000000.00

TRSKFTFA1819

26.12.2018

500000.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR

: