

YKP
(YDP) YAPI KREDİ PORTFOY PY ÜÇÜNCÜ DEĞİSKEN ÖZEL FON
ŞUBAT 2019 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	:	510,193,104.23
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	24,384,193,471.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	20.07.2012
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.020923
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.020662
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.26%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	4.72%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	20.53%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		7.22%
Devlet Tahvili		41.59%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		24.46%
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		3.01%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		10.07%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		1.06%
Yabancı Hisse Senetleri		0.00%
VIOP Nakit Teminat		1.37%

Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	1.08%
Vadeli_YP	3.62%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	5.33%
Katılma Belgesi YP	0.00%
CC Swap	0.00%
FX Swap	0.00%
IR Swap	0.00%
VDMK	1.17%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	48.46%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	17.80%
Devlet Borçlanma Senetleri	28.66%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	415.819
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	0.00
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	4,839,999.96

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
AKBNK	290,000.00	1,992,300.00	0.39
ARCLK	56,500.00	1,176,330.00	0.23
ASELS	80,000.00	1,961,600.00	0.38
BIMAS	25,750.00	2,206,775.00	0.43
ENKAI	60,000.54	300,002.72	0.06
EREGL	150,000.00	1,398,000.00	0.27
FROTO	11,049.00	612,667.05	0.12
GARAN	290,000.00	2,586,800.00	0.51
ISDMR	60,000.00	444,000.00	0.09
ISGYO	1.08	1.14	0.00
KAREL	80.00	551.20	0.00
KCHOL	145,000.00	2,702,800.00	0.53
KORDS	33,000.00	355,080.00	0.07
KRDMD	750,000.00	1,987,500.00	0.39
MGROS	81,000.00	1,271,700.00	0.25
ODAS	0.58	1.12	0.00
OTKAR	8,624.00	1,026,256.00	0.20
PGSUS	70,000.00	2,065,000.00	0.40
SISE	0.53	3.59	0.00
SODA	260,000.02	1,981,200.13	0.39
TAVHL	20,500.00	570,310.00	0.11
TCELL	140,000.00	2,002,000.00	0.39
THYAO	100,000.00	1,414,000.00	0.28

TKFEN	30,000.00	792,000.00	0.16
TSKB	400,000.00	336,000.00	0.07
TTKOM	275,000.00	1,493,250.00	0.29
TUPRS	15,500.00	2,224,250.00	0.44
VAKBN	400,001.00	2,064,005.16	0.40
YKBNK	700,000.32	1,505,000.69	0.29
TOPLAM	4,452,007.07	36,469,383.78	7.15
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI	:		
TRT050220T17	30,300,000.00	27,631,176.00	5.42
TRT080328T15	100,000.00	95,558.00	0.02
TRT100719T18	6,000,000.00	5,849,580.00	1.15
TRT110226T13	5,500,000.00	4,529,085.00	0.89
TRT110827T16	269,000.00	215,770.28	0.04
TRT120325T12	20,000.00	15,178.00	0.00
TRT120820T12	25,200,000.00	27,010,872.00	5.29
TRT131119T19	19,000,000.00	18,978,720.00	3.72
TRT140623T19	300,000.00	315,543.00	0.06
TRT140922T17	5,000,000.00	4,235,050.00	0.83
TRT150120T16	18,200,000.00	17,254,510.00	3.38
TRT150519T15	4,400,000.00	4,463,184.00	0.87
TRT170221T12	29,800,000.00	26,693,648.00	5.23
TRT170822T15	6,100,000.00	5,272,291.00	1.03
TRT180123T10	10,700,000.00	9,734,646.00	1.91
TRT200324T13	67,000.00	58,777.09	0.01
TRT220921T18	53,200,000.00	47,298,524.00	9.27
TRT240724T15	22,000.00	17,271.10	0.00
TOPLAM	214,178,000.00	199,669,383.47	39.13
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ	:		
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)	:		
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER	:		
TRT150121F11	1,500,000.00	9,164,270.45	1.80
TOPLAM	1,500,000.00	9,164,270.45	1.80
F) FİNANSMAN BONOLARI	:		
TRFAKYM31922	4,500,000.00	4,424,490.00	0.87
TRFFFKR41936	2,200,000.00	2,147,288.00	0.42
TRFFNBK41934	3,000,000.00	2,915,940.00	0.57
TRFHLLFK51918	3,000,000.00	2,876,100.00	0.56
TRFISFA41921	940,000.00	910,822.40	0.18
TRFISFN31917	3,480,000.00	3,457,414.80	0.68
TRFISFN31933	13,660,000.00	13,419,720.60	2.63
TRFISFN41916	5,000,000.00	4,886,650.00	0.96
TRFISFN41957	3,000,000.00	2,916,120.00	0.57
TRFISFN51923	8,000,000.00	7,601,600.00	1.49
TRFKCTY41914	1,600,000.00	1,561,360.00	0.31
TRFYKFK41915	3,000,000.00	2,928,600.00	0.57
TRFYKFK41916	1,350,000.00	1,316,884.50	0.26
TRFYKFK41924	5,000,000.00	4,857,300.00	0.95
TRFYKFK51915	1,650,000.00	1,589,098.50	0.31

TRFYKYM31914	10,000,000.00	9,885,800.00	1.94
TOPLAM	69,380,000.00	67,695,188.80	13.27
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSARCL22117	5,000,000.00	5,047,150.00	0.99
TRSAYGZ12024	1,000,000.00	901,090.00	0.18
TRSCMK31910	2,000,000.00	2,247,060.00	0.44
TRSENSA72211	5,100,000.00	6,337,719.00	1.24
TRSGFYH31914	1,360,000.00	1,415,651.20	0.28
TRSKCTF32014	2,000,000.00	2,014,840.00	0.39
TRSKCTY62012	1,000,000.00	1,028,120.00	0.20
TRSKFTF42016	1,900,000.00	1,882,881.00	0.37
TRSKRSNE2018	2,000,000.00	2,013,060.00	0.39
TRSOPAS22111	1,000,000.00	989,260.00	0.19
TRSOPAS22129	4,200,000.00	4,219,824.00	0.83
TRSOPAS42010	5,320,000.00	5,610,631.60	1.10
TRSORFN31910	2,400,000.00	2,379,024.00	0.47
TRSOTKO12013	5,000,000.00	5,080,350.00	1.00
TRSTHALE2716	500,000.00	504,355.00	0.10
TRSTIMGE1918	1,000,000.00	998,540.00	0.20
TRSTISB72712	5,010,000.00	5,071,172.10	0.99
TRSTPRS12115	4,000,000.00	4,096,680.00	0.80
TRSVKFB92719	2,010,000.00	2,093,455.20	0.41
XS1629734879	2,350,000.00	2,222,148.25	0.44
TOPLAM	54,150,000.00	56,153,011.35	11.01
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
XS1117601796	1000000.00	5396401.96	1.06
TOPLAM	1,000,000.00	5,396,401.96	1.06
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TRT100124T17	14,856,815.00	14,698,143.26	2.88
TRT110226T13	19,142,950.00	15,039,212.24	2.95
TRT110320T18	479,225.00	500,335.62	0.10
TRT120820T12	1,745,890.00	1,812,932.08	0.36
TOPLAM	36,224,880.00	32,050,623.20	6.28
L) DİĞER	:		
Forward EURO/TL	-1,700,000.00		
Forward EURO/TL	-1,500,000.00		
GLDTRf	1,250,000.00	25,531,250.00	5.00
YPF	1,094,719.00	1,530,575.90	0.30
YPL	400,000.00	2,224,883.14	0.44
Vadeli Mevduat YP gün 41	2,000,000.00	10,659,238.66	2.09
Vadeli Mevduat YP gün 41	1,700,000.00	10,308,283.52	2.02
F_XAUUSD0419	1,350.00	9,505,215.92	
BPP	10,288,493.15	10,179,481.42	2.00

BPP	20,446,849.32	20,303,530.03	3.98
BPP	10,217,041.10	10,132,620.33	1.99
BPP	94,061.55	94,061.55	0.02
TOPLAM		90,963,924.55	17.83
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		
	6,798,462.43	6,798,462.43	1.33
TOPLAM	6,798,462.43	6,798,462.43	1.33
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
O) VDMK	:		
TRPKYVFA2318	5,500,000.00	5,873,230.00	1.15
TOPLAM	5,500,000.00	5,873,230.00	1.15
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	510,233,880.00
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	3,521.60
C. ALACAKLAR (+)	:	662,975.00
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	707,272.37
FON TOPLAM DEĞERİ	:	510,193,104.23

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	77,427.88
37002 Denetim Ücreti	708.12
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	981.20
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	2,957.57
370033 Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	882.00
37004 Aracılık Komisyonu	4,593.91
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	5,187.10
37006 Saklama Giderleri	5,516.11
37008 Banka Masrafları	703.57
37010 Kap Gideri	238.84
370141 İMKB Endeksi Lisans Sözleşmesi	1,239.00
370142 KYD Endeks Lisans Giderleri	1,858.50
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	7,624.36
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	7,826.86
37023 VIOP İşlemi Komisyonu	16,408.22
37028 Portföy Saklama Hizmeti	2,789.50
37030 E-fatura Gideri	118.00
37099 Diğer Giderler	132.72
Toplam	137,193.46

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

TRFKFTF21918

01.02.2019

5000000.00

TRSZFKL21916

14.02.2019

2630000.00

TRFAKBK21917

15.02.2019

8000000.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR

:

10- ÖDÜNÇ İŞLEMLER

:

A) ÖDÜNÇ VERİLEN

:

Sermaye Piyasası Aracı

:

Menkul Kıymet

Nominal

Vade Tarihi

Cari Piyasa Değeri

B) ÖDÜNÇ ALINAN

:

Sermaye Piyasası Aracı

:

Menkul Kıymet

Nominal

Vade Tarihi

Cari Piyasa Değeri