

YKP
(YDP) YAPI KREDİ PORTFOY PY ÜÇÜNCÜ DEĞİSKEN ÖZEL FON
EKİM 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	:	619,872,438.08
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	25,227,328,659.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	20.07.2012
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.024571
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.024253
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.31%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	22.98%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	29.00%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		7.30%
Devlet Tahvili		50.29%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		16.52%
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%
Eurobond Repo		0.00%
Devlet Tahvili Ters Repo		14.80%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Eurobond Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		0.97%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.84%

Yabancı Hisse Senetleri	0.00%
VIOP Nakit Teminat	1.04%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	0.01%
Vadeli_YP	2.65%
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%
CD Swap	0.00%
VDMK	0.25%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 53.45%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	12.46%
Devlet Borçlanma Senetleri	110.07%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 375.594
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 3,406,999.85
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	: 84,655,986.49

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
AKBNK	375,000.00	2,591,250.00	0.45
ALBRK	200,000.00	244,000.00	0.04
ARCLK	56,500.00	1,001,180.00	0.17
ASELS	117,500.00	2,156,125.00	0.37
BIMAS	56,500.00	2,673,580.00	0.46
ENKAI	0.54	3.13	0.00
EREGL	500,009.00	3,270,058.86	0.57
FROTO	14,049.00	906,160.50	0.16
GARAN	380,184.00	3,497,692.80	0.61
HALKB	100,000.00	524,000.00	0.09
ISCTR	200,000.00	1,160,000.00	0.20
ISDMR	60,000.00	364,200.00	0.06
ISGYO	1.08	1.00	0.00
KAREL	6,830.00	79,979.30	0.01
KCHOL	145,000.00	2,715,850.00	0.47
KORDS	74,000.00	867,280.00	0.15
KRDMD	200,000.00	432,000.00	0.08
ODAS	0.58	0.99	0.00
OTKAR	10,069.00	1,414,694.50	0.25
PETKM	475,000.00	1,634,000.00	0.28

PGSUS	42,098.00	2,780,572.90	0.48
SISE	105,014.53	456,813.21	0.08
SODA	265,000.02	1,452,200.09	0.25
TAVHL	5,500.00	143,440.00	0.02
TCELL	260,000.00	3,268,200.00	0.57
THYAO	235,000.00	2,735,400.00	0.48
TKFEN	62,000.00	1,050,900.00	0.18
TSKB	800,000.00	720,000.00	0.13
TTKOM	250,000.00	1,452,500.00	0.25
TUPRS	25,500.00	3,174,750.00	0.55
VAKBN	350,001.00	1,519,004.34	0.26
YKBNK	850,000.32	1,938,000.73	0.34
TOPLAM	6,220,757.07	46,223,837.36	8.03
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI	:		
TRT050220T17	56,300,000.00	56,589,382.00	9.84
TRT080328T15	100,000.00	100,183.00	0.02
TRT100620T16	25,000,000.00	23,297,250.00	4.05
TRT110226T13	52,500,000.00	49,225,050.00	8.56
TRT110827T16	269,000.00	246,893.58	0.04
TRT120325T12	20,000.00	16,396.00	0.00
TRT120820T12	200,000.00	225,630.00	0.04
TRT131119T19	20,500,000.00	21,741,685.00	3.78
TRT140623T19	300,000.00	346,419.00	0.06
TRT140922T17	18,500,000.00	16,985,405.00	2.95
TRT150120T16	17,200,000.00	17,663,712.00	3.07
TRT170221T12	38,300,000.00	38,384,260.00	6.67
TRT170822T15	6,100,000.00	5,889,550.00	1.02
TRT180123T10	31,200,000.00	32,070,168.00	5.57
TRT200324T13	67,000.00	62,766.94	0.01
TRT201021T25	55,000,000.00	56,436,600.00	9.81
TRT210421T14	5,000,000.00	5,587,050.00	0.97
TRT220921T18	200,000.00	192,582.00	0.03
TRT240724T15	24,022,000.00	21,649,827.50	3.76
TOPLAM	350,778,000.00	346,710,810.02	60.27
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
TRT110226T13	-30,000,000.00	-28,242,600.00	-4.91
TRT140922T17	-5,000,000.00	-4,629,950.00	-0.80
TRT240724T15	-12,000,000.00	-10,815,600.00	-1.88
TOPLAM	-47,000,000.00	-43,688,150.00	-7.59
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ	:		
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)	:		
E) DÖVİZE ENDEKSİLİ TAHVİLLER	:		
F) FİNANSMAN BONOLARI	:		
TRFTCZB82013	3,550,000.00	3,665,801.00	0.64
TRFTHALK1913	2,000,000.00	2,039,420.00	0.35
TOPLAM	5,550,000.00	5,705,221.00	0.99
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSARCL22117	9,800,000.00	10,163,482.00	1.77

TRSARCL72112	7,300,000.00	7,400,448.00	1.29
TRSAYGZ12024	1,000,000.00	1,025,660.00	0.18
TRSAYGZ62110	2,800,000.00	2,852,108.00	0.50
TRSENSA72211	5,100,000.00	6,887,958.00	1.20
TRSERGL52117	2,900,000.00	3,033,081.00	0.53
TRSKCTF32014	2,000,000.00	2,024,240.00	0.35
TRSKCTY32015	110,000.00	113,111.90	0.02
TRSKCTY62012	1,000,000.00	1,051,380.00	0.18
TRSKFTF42016	1,900,000.00	2,044,989.00	0.36
TRSKFTF62113	150,000.00	153,568.50	0.03
TRSKRSNE2018	2,000,000.00	2,017,160.00	0.35
TRSOPAS22111	1,000,000.00	1,033,650.00	0.18
TRSOPAS22129	4,370,000.00	4,559,701.70	0.79
TRSOPAS42010	5,320,000.00	5,178,807.20	0.90
TRSOTKO12013	5,000,000.00	5,265,950.00	0.92
TRSOTKO32110	6,000,000.00	6,184,020.00	1.07
TRSTHALE2716	500,000.00	503,450.00	0.09
TRSTISB72712	5,140,000.00	5,366,571.20	0.93
TRSTISB92918	8,000,000.00	8,135,040.00	1.41
TRSTPRS12115	4,000,000.00	4,015,880.00	0.70
TRSTTRK42012	140,000.00	143,036.60	0.02
TRSVKFB92719	2,170,000.00	2,219,931.70	0.39
TRSYKBK62914	6,300,000.00	6,384,231.00	1.11
TRSYKBK92911	10,000,000.00	10,135,500.00	1.76
XS1629734879	2,350,000.00	2,469,791.25	0.43
TOPLAM	96,350,000.00	100,362,747.05	17.45
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TRT050624T35	7,666,870.00	8,003,210.96	1.39
TRT110226T13	30,194,560.00	27,010,836.98	4.70
TRT140922T17	14,713,950.00	13,005,217.80	2.26
TOPLAM	52,575,380.00	48,019,265.74	8.35
L) DİĞER	:		
GLDTRF	1,250,000.00	31,096,250.00	5.41
YPF	1,094,719.00	1,724,792.18	0.30
YSF	1,235,967.00	1,107,719.36	0.19
YPL	400,000.00	2,479,731.19	0.43
Vadeli Mevduat YP gün 35	1,531,619.51	9,760,638.41	1.70
Vadeli Mevduat YP gün 36	2,032,940.85	11,623,861.18	2.02
Vadeli Mevduat YP gün 4	1,026,891.88	5,861,903.27	1.02
BPP	285,102.68	285,102.68	0.05
TOPLAM		63,939,998.27	11.11
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		

		6,431,331.35	6,431,331.35	1.12
TOPLAM		6,431,331.35	6,431,331.35	1.12
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
O) VDMK	:			
TRPTYV232410		1,500,000.00	1,590,360.00	0.28
TOPLAM		1,500,000.00	1,590,360.00	0.28
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	575,295,420.79
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	5,220.44
C. ALACAKLAR (+)	:	44,719,637.16
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	147,840.31
FON TOPLAM DEĞERİ	:	619,872,438.08

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	110,668.43
37002 Denetim Ücreti	806.00
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	4,480.42
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	22,033.20
370033 Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	3,087.00
370034 Yabancı Menkul Komisyonu	128.82
37004 Aracılık Komisyonu	4,080.74
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	26,005.99
37006 Saklama Giderleri	6,729.63
37008 Banka Masrafları	344.84
37010 Kap Gideri	264.43
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	767.19
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	11,185.87
37023 VIOP İşlemi Komisyonu	45,377.43
37028 Portföy Saklama Hizmeti	4,095.00
37030 E-fatura Gideri	354.00
37099 Diğer Giderler	146.94
Toplam	240,555.93

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

Açıklama	Giriş Tarihi	Stok	Kazanılan Nominal
TCELL Tem :%45.91	31.10.2019	260000.00	119363.63

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR

8- İTFALAR

Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal
TRSTIMGE1918	02.10.2019	1000000.00
XS1891679547	02.10.2019	8000000.00
TSKB301019	30.10.2019	1000000.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR :

10- ÖDÜNÇ İŞLEMLER :

A) ÖDÜNÇ VERİLEN :

Sermaye Piyasası Aracı :

B) ÖDÜNÇ ALINAN :

Sermaye Piyasası Aracı :

Menkul Kıymet

Nominal

Vade Tarihi

Cari Piyasa Değeri

Menkul Kıymet

Nominal

Vade Tarihi

Cari Piyasa Değeri