

YKP
(YDP) YAPI KREDİ PORTFOY PY ÜÇÜNCÜ DEĞİSKEN ÖZEL FON
KASIM 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	:	639,030,620.71
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	25,567,260,672.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	20.07.2012
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.024994
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.024571
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.72%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	25.10%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	26.86%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		7.94%
Devlet Tahvili		50.99%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		16.58%
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		12.39%
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		1.32%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.88%

Yabancı Hisse Senetleri	0.00%
VIOP Nakit Teminat	0.92%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	0.00%
Vadeli_YP	3.43%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	5.27%
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	: 50.75%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	13.50%
Devlet Borçlanma Senetleri	97.19%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 545.395
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 8,499,999.99
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	: 0.00

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
AKBNK	400,000.00	3,108,000.00	0.49
ALBRK	200,000.00	268,000.00	0.04
ARCLK	67,500.00	1,358,100.00	0.21
ASELS	117,500.00	2,193,725.00	0.34
BIMAS	56,500.00	2,599,000.00	0.41
ENKAI	0.54	3.13	0.00
EREGL	500,009.00	4,010,072.18	0.63
PROTO	14,049.00	896,326.20	0.14
GARAN	380,184.00	3,839,858.40	0.60
HALKB	100,000.00	577,000.00	0.09
ISCTR	200,000.00	1,230,000.00	0.19
ISDMR	60,000.00	419,400.00	0.07
ISGYO	1.08	1.22	0.00
KAREL	48,000.00	733,440.00	0.11
KCHOL	145,000.00	2,902,900.00	0.45
KORDS	74,000.00	880,600.00	0.14
KRDMD	200,000.00	478,000.00	0.07
ODAS	0.58	0.92	0.00
OTKAR	12,100.00	1,808,950.00	0.28
PETKM	350,000.00	1,256,500.00	0.20

PGSUS	37,750.00	2,738,762.50	0.43
SISE	105,014.53	524,022.51	0.08
SODA	175,000.02	1,015,000.10	0.16
TCELL	210,000.00	2,847,600.00	0.45
THYAO	250,000.00	3,415,000.00	0.53
TKFEN	160,000.00	3,024,000.00	0.47
TSKB	800,000.00	824,000.00	0.13
TTKOM	200,000.00	1,352,000.00	0.21
TUPRS	22,500.00	2,787,750.00	0.44
VAKBN	350,001.00	1,795,505.13	0.28
YATAS	100,000.00	609,000.00	0.10
YKBNK	850,000.32	2,040,000.77	0.32
TOPLAM	6,185,110.07	51,532,518.05	8.06
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI	:		
TRT050220T17	3,800,000.00	3,864,942.00	0.60
TRT080328T15	100,000.00	104,078.00	0.02
TRT110226T13	37,500,000.00	36,123,375.00	5.65
TRT110827T16	269,000.00	255,289.07	0.04
TRT120325T12	20,000.00	17,213.00	0.00
TRT120820T12	200,000.00	229,072.00	0.04
TRT140623T19	300,000.00	358,104.00	0.06
TRT140922T17	13,500,000.00	12,760,875.00	2.00
TRT150120T16	200,000.00	207,678.00	0.03
TRT170221T12	300,000.00	306,306.00	0.05
TRT170822T15	6,100,000.00	6,132,635.00	0.96
TRT180123T10	76,200,000.00	80,026,002.00	12.52
TRT200324T13	67,000.00	64,657.01	0.01
TRT201021T25	65,500,000.00	68,645,310.00	10.74
TRT210421T14	12,000,000.00	13,652,280.00	2.14
TRT220921T18	35,200,000.00	34,437,568.00	5.39
TRT240724T15	12,522,000.00	11,567,948.82	1.81
TOPLAM	263,778,000.00	268,753,332.90	42.05
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ	:		
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)	:		
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER	:		
F) FİNANSMAN BONOLARI	:		
TRFTCZB82013	3,550,000.00	3,589,121.00	0.56
TOPLAM	3,550,000.00	3,589,121.00	0.56
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSARCL22117	10,330,000.00	10,376,071.80	1.62
TRSARCL72112	7,300,000.00	7,439,722.00	1.16
TRSAYGZ12024	1,000,000.00	1,043,740.00	0.16
TRSAYGZ62110	2,800,000.00	2,890,916.00	0.45
TRSENSA72211	5,100,000.00	7,136,685.00	1.12
TRSERGL52117	2,900,000.00	2,941,673.00	0.46
TRSKCTF32014	2,000,000.00	2,051,600.00	0.32
TRSKCTY32015	110,000.00	114,687.10	0.02

TRSKCTY62012	1,000,000.00	1,063,030.00	0.17
TRSKFTF42016	1,900,000.00	1,920,368.00	0.30
TRSKFTF62113	150,000.00	155,817.00	0.02
TRSKRSNE2018	2,000,000.00	2,048,840.00	0.32
TRSOPAS22111	1,000,000.00	998,940.00	0.16
TRSOPAS22129	4,370,000.00	4,414,748.80	0.69
TRSOPAS42010	5,320,000.00	5,274,886.40	0.83
TRSOTKO12013	5,000,000.00	5,359,700.00	0.84
TRSOTKO32110	6,000,000.00	6,269,040.00	0.98
TRSTHALE2716	500,000.00	501,510.00	0.08
TRSTISB72712	5,140,000.00	5,185,232.00	0.81
TRSTISB92918	8,000,000.00	8,253,120.00	1.29
TRSTPRS12115	4,000,000.00	4,069,040.00	0.64
TRSTTRK42012	140,000.00	144,534.60	0.02
TRSVKFB92719	2,170,000.00	2,253,870.50	0.35
TRSYKBK62914	6,300,000.00	6,472,431.00	1.01
TRSYKBK92911	10,000,000.00	10,265,500.00	1.61
XS1629734879	2,350,000.00	2,502,691.25	0.39
TOPLAM	96,880,000.00	101,148,394.45	15.82
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
XS1079527211	1000000.00	5878612.53	0.92
TOPLAM	1,000,000.00	5,878,612.53	0.92
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TRT010420T19	3,949,595.00	9,510,931.50	1.49
TRT030523T13	8,497,920.00	15,017,260.27	2.35
TRT041126T11	15,904,315.00	15,517,835.62	2.43
TRT050624T35	715,275.00	773,308.81	0.12
TRT060121T16	10,815,770.00	25,028,767.12	3.92
TRT060825T15	3,397,320.00	3,504,027.40	0.55
TRT070727T13	11,756,210.00	15,017,260.27	2.35
TRT071020T23	10,229,395.00	9,010,356.16	1.41
TRT080328T15	19,915,870.00	20,023,013.70	3.13
TRT110827T16	11,995,575.00	11,012,657.53	1.72
TRT210421T14	13,608,510.00	15,017,260.28	2.35
TRT240724T15	4,733,650.00	4,232,444.61	0.66
TOPLAM	115,519,405.00	143,665,123.27	22.48
L) DİĞER	:		
GLDTRF	1,250,000.00	30,157,500.00	4.72
YPF	1,094,719.00	1,732,304.15	0.27
YSF	1,235,967.00	1,106,508.11	0.17
YPL	400,000.00	2,515,114.74	0.39
Vadeli Mevduat YP gün 35	2,038,454.85	11,713,597.97	1.83
Vadeli Mevduat YP gün 40	1,532,280.41	9,680,977.05	1.51
BPP	451,481.89	451,481.89	0.07

TOPLAM		57,357,483.91	8.97
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		

		5,647,452.24	5,647,452.24	0.88
TOPLAM		5,647,452.24	5,647,452.24	0.88
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
O) VDMK	:			
TRPTYV232410		1,500,000.00	1,611,045.00	0.25
TOPLAM		1,500,000.00	1,611,045.00	0.25
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	639,183,083.35
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	1,876.35
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	154,338.99
FON TOPLAM DEĞERİ	:	639,030,620.71

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	107,629.15
37002 Denetim Ücreti	806.00
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	5,216.16
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	17,211.60
370033 Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	3,528.00
37004 Aracılık Komisyonu	4,408.53
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	122.90
37006 Saklama Giderleri	6,396.87
37008 Banka Masrafları	398.08
37010 Kap Gideri	264.43
370142 KYD Endeks Lisans Giderleri	3,982.50
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	1,305.09
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	10,880.44
37023 VIOP İşlemi Komisyonu	15,037.53
37028 Portföy Saklama Hizmeti	4,095.00
37099 Diğer Giderler	146.94
Toplam	181,429.22

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

Açıklama	Giriş Tarihi	Stok	Kazanılan Nominal
ENKAI Tem :%14.00	13.11.2019	0.54	0.08
BIMAS Tem :%60.00	18.11.2019	56500.00	33900.00
FROTO Tem :%123.00	19.11.2019	14049.00	17280.27

KRDMD Tem :%13.16	27.11.2019	200000.00	26315.78
-------------------	------------	-----------	----------

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR :

8- İTFALAR :

Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal
TRFTHALK1913	06.11.2019	2000000.00
TRT131119T19	13.11.2019	20500000.00

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
------------------------	---------------	---------	-------------	--------------------