

**YKP**  
**(YAU) YAPI KREDİ PORTFOY BIST 100 ENDEKSİ HİSSE SENEDİ FONU (HİSSE SENEDİ**  
**YOGUN FON)**  
**ŞUBAT 2020 AYLIK RAPORUDUR.**

**1- FONU TANITICI BİLGİLER**

|                                   |   |                                                                           |
|-----------------------------------|---|---------------------------------------------------------------------------|
| A. FONUN ADI                      | : | (YAU) YAPI KREDİ PORTFOY BIST 100 ENDEKSİ HİSSE SENEDİ FONU (HİSSE SENEDİ |
| B. KURUCUNUN UNVANI               | : | YOGUN FON)                                                                |
| C. YÖNETİCİNİN UNVANI             | : | YKP                                                                       |
|                                   | : | YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.                                          |
| Ç. FON TUTARI                     | : | 1,000,000.00                                                              |
| D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ | : | 129,089,158.46                                                            |
| E. KATILMA PAYI SAYISI            | : | 32,150,432.00                                                             |
| F. FONUN KURULUŞ TARİHİ           | : | 17.12.1993                                                                |
| G. FONUN SÜRESİ                   | : | Süresiz                                                                   |

**2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER**

|                                                        |   |          |
|--------------------------------------------------------|---|----------|
| A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI                         | : | 4.015161 |
| B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI                       | : | 4.423121 |
| C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI               | : | -9.22%   |
| Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI                    | : | -6.29%   |
| D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI              | : | 5.41%    |
| E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ | : |          |
| Hisse Senedi                                           |   | 86.68%   |
| Devlet Tahvili                                         |   | 0.00%    |
| Hazine Bonosu                                          |   | 0.00%    |
| Özel Sektör Tahvili                                    |   | 0.00%    |
| 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                               |   | 12.01%   |
| 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                                    |   | 1.31%    |
| Kıymetli Madenler                                      |   | 0.00%    |
| Yabancı Sabit Getirililer                              |   | 0.00%    |

|                                                           |                 |
|-----------------------------------------------------------|-----------------|
| Euro Bond (Euro Tahvil Türk)                              | 0.00%           |
| Yabancı Hisse Senetleri                                   | 0.00%           |
| VIOP Nakit Teminat                                        | 0.00%           |
| Varant                                                    | 0.00%           |
| Forward                                                   | 0.00%           |
| Vadeli_TL                                                 | 0.00%           |
| Vadeli_YP                                                 | 0.00%           |
| Opsiyon APG                                               | 0.00%           |
| Opsiyon                                                   | 0.00%           |
| Katılma Belgesi                                           | 0.00%           |
| Katılma Belgesi YP                                        | 0.00%           |
| Katılım Hesabı                                            | 0.00%           |
| CC Swap                                                   | 0.00%           |
| FX Swap                                                   | 0.00%           |
| IR Swap                                                   | 0.00%           |
| CD Swap                                                   | 0.00%           |
| VDMK                                                      | 0.00%           |
| F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI                           | : 0.06%         |
| G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI                      | :               |
| Hisse Senedi                                              | 23.86%          |
| Devlet Borçlanma Senetleri                                | 0.00%           |
| Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ                              | : 1.400         |
| H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ | : 42,784,826.18 |
| I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI  | : 14,626,443.12 |
| J. AYLIK KORELASYON                                       | : 0.9973074     |
| K. ÜÇ AYLIK KORELASYON                                    | : 0.9980214     |

### 3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

|                    | Nominal Değeri | Rayiç Değeri | %    |
|--------------------|----------------|--------------|------|
| A) HİSSE SENETLERİ |                |              |      |
| AEFES              | 61,500.35      | 1,349,317.70 | 1.04 |
| AKBNK              | 1,214,999.55   | 8,213,396.94 | 6.34 |
| AKENR              | 0.41           | 0.43         | 0.00 |
| AKSA               | 31,500.00      | 248,850.00   | 0.19 |
| ALARK              | 30,000.73      | 167,104.07   | 0.13 |
| ALBRK              | 52,500.00      | 70,875.00    | 0.05 |
| ANACM              | 220,000.00     | 829,400.00   | 0.64 |
| ARCLK              | 46,000.85      | 854,695.79   | 0.66 |
| ASELS              | 270,000.00     | 7,425,000.00 | 5.73 |
| BIMAS              | 164,490.00     | 7,902,099.60 | 6.10 |
| CCOLA              | 17,000.00      | 766,700.00   | 0.59 |
| CLEBI              | 1,200.00       | 96,000.00    | 0.07 |
| DGGYO              | 1.25           | 7.07         | 0.00 |
| DOHOL              | 250,000.28     | 430,000.49   | 0.33 |
| ECILC              | 20,000.00      | 76,400.00    | 0.06 |
| EGEEN              | 2,500.00       | 1,668,750.00 | 1.29 |

|        |               |                |       |
|--------|---------------|----------------|-------|
| EKGYO  | 1,165,000.00  | 1,619,350.00   | 1.25  |
| ENJSA  | 63,000.00     | 490,770.00     | 0.38  |
| ENKAI  | 192,000.01    | 1,234,560.09   | 0.95  |
| EREGL  | 995,000.10    | 8,208,750.83   | 6.34  |
| FROTO  | 18,000.20     | 1,404,015.60   | 1.08  |
| GARAN  | 912,859.50    | 8,672,165.25   | 6.70  |
| GOZDE  | 33,000.00     | 122,100.00     | 0.09  |
| GUBRF  | 20,000.00     | 341,000.00     | 0.26  |
| HALKB  | 175,000.00    | 1,046,500.00   | 0.81  |
| HURGZ  | 0.99          | 1.08           | 0.00  |
| ISCTR  | 662,999.68    | 3,785,728.17   | 2.92  |
| ISDMR  | 39,000.00     | 276,900.00     | 0.21  |
| ISFIN  | 100,000.33    | 313,001.02     | 0.24  |
| ISGYO  | 120,000.56    | 195,600.91     | 0.15  |
| KARSN  | 0.70          | 1.16           | 0.00  |
| KARTN  | 200.00        | 76,000.00      | 0.06  |
| KCHOL  | 248,000.28    | 4,265,604.73   | 3.29  |
| KORDS  | 75,000.00     | 1,044,750.00   | 0.81  |
| KRDMD  | 205,000.01    | 533,000.01     | 0.41  |
| MAVI   | 10,000.00     | 535,000.00     | 0.41  |
| MGROS  | 18,000.00     | 391,680.00     | 0.30  |
| MPARK  | 13,865.00     | 206,449.85     | 0.16  |
| OTKAR  | 10,837.00     | 1,636,387.00   | 1.26  |
| PEKGY  | 0.66          | 1.84           | 0.00  |
| PETKM  | 906,000.24    | 3,297,840.88   | 2.55  |
| PGSUS  | 10,000.00     | 540,000.00     | 0.42  |
| QNBFB  | 0.42          | 16.02          | 0.00  |
| SAHOL  | 953,000.72    | 8,110,036.13   | 6.26  |
| SASA   | 61,157.48     | 533,293.22     | 0.41  |
| SISE   | 252,000.87    | 1,217,164.22   | 0.94  |
| SKBNK  | 85,000.80     | 94,350.89      | 0.07  |
| SODA   | 133,685.25    | 774,037.58     | 0.60  |
| TAVHL  | 42,000.00     | 855,120.00     | 0.66  |
| TCELL  | 467,000.16    | 6,463,282.16   | 4.99  |
| THYAO  | 340,000.79    | 3,995,009.32   | 3.08  |
| TKFEN  | 226,099.93    | 3,357,584.02   | 2.59  |
| TOASO  | 33,000.44     | 876,491.77     | 0.68  |
| TRCAS  | 0.82          | 2.70           | 0.00  |
| TRKCM  | 94,999.96     | 317,299.86     | 0.24  |
| TSKB   | 285,000.46    | 313,500.51     | 0.24  |
| TTKOM  | 150,000.00    | 1,129,500.00   | 0.87  |
| TUPRS  | 56,300.00     | 5,703,190.00   | 4.40  |
| ULKER  | 39,000.65     | 798,733.25     | 0.62  |
| VAKBN  | 305,000.66    | 1,616,503.47   | 1.25  |
| YATAS  | 21,000.00     | 160,019.96     | 0.12  |
| YKBNK  | 900,000.01    | 2,061,000.03   | 1.59  |
| ZOREN  | 80,000.59     | 106,400.78     | 0.08  |
| TOPLAM | 12,898,708.68 | 108,818,291.41 | 84.01 |

B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI :

|                                             |   |                |               |       |
|---------------------------------------------|---|----------------|---------------|-------|
| VALÖRLÜ İŞLEMLER                            | : |                |               |       |
| C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ                | : |                |               |       |
| D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)    | : |                |               |       |
| E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER                | : |                |               |       |
| F) FİNANSMAN BONOLARI                       | : |                |               |       |
| VALÖRLÜ İŞLEMLER                            | : |                |               |       |
| G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ                   | : |                |               |       |
| VALÖRLÜ İŞLEMLER                            | : |                |               |       |
| H) KİRA SERTİFİKALARI                       | : |                |               |       |
| VALÖRLÜ İŞLEMLER                            | : |                |               |       |
| I) YABANCI MENKUL KIYMETLER                 | : |                |               |       |
| İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER         | : |                |               |       |
| J) REPO                                     | : |                |               |       |
| K) TERS REPO                                | : |                |               |       |
| TRT060825T15                                |   | 20,324,550.00  | 20,017,852.05 | 15.45 |
| TOPLAM                                      |   | 20,324,550.00  | 20,017,852.05 | 15.45 |
| L) DİĞER                                    | : |                |               |       |
| BPP                                         |   | 695,648.35     | 695,648.35    | 0.54  |
| TOPLAM                                      |   |                | 695,648.35    | 0.54  |
| M) VARANT                                   | : |                |               |       |
| N) VIOP NAKİT TEMİNAT                       | : |                |               |       |
| O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER                  | : |                |               |       |
| VALÖRLÜ İŞLEMLER                            | : |                |               |       |
| O) VDMK                                     | : |                |               |       |
| VALÖRLÜ İŞLEMLER                            | : |                |               |       |
| 4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU                | : |                |               |       |
| A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU               | : | 129,531,791.81 |               |       |
| B. HAZİR DEĞERLER (+)                       | : | 6,592.14       |               |       |
| C. ALACAKLAR (+)                            | : | 7,523.27       |               |       |
| D. DİĞER VARLIKLAR (+)                      | : | 0.00           |               |       |
| E. BORÇLAR (-)                              | : | 456,748.76     |               |       |
| FON TOPLAM DEĞERİ                           | : | 129,089,158.46 |               |       |
| 5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER               | : |                |               |       |
| Açıklama                                    |   |                | Tutarı        |       |
| 37001 Fon Yönetim Ücreti                    |   | 199,810.54     |               |       |
| 37002 Denetim Ücreti                        |   | 728.00         |               |       |
| 370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı            |   | 3,847.20       |               |       |
| 37004 Aracılık Komisyonu                    |   | 11,437.25      |               |       |
| 37005 Vergi, Resim ve Harçlar               |   | 150.50         |               |       |
| 37006 Saklama Giderleri                     |   | 819.42         |               |       |
| 37010 Kap Gideri                            |   | 119.28         |               |       |
| 370141 İMKB Endeksi Lisans Sözleşmesi       |   | 3,898.16       |               |       |
| 370142 KYD Endeks Lisans Giderleri          |   | 885.00         |               |       |
| 37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu |   | 1,161.99       |               |       |
| 37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti          |   | 2,018.37       |               |       |
| 37028 Portföy Saklama Hizmeti               |   | 4,144.00       |               |       |

|        |                 |            |
|--------|-----------------|------------|
| 37030  | E-fatura Gideri | 118.00     |
| 37099  | Diğer Giderler  | 132.72     |
| Toplam |                 | 229,270.43 |

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

| Açıklama         | Giriş Tarihi | Stok     | Kazanılan Nominal |
|------------------|--------------|----------|-------------------|
| AKSA Bds :%75.00 | 12.02.2020   | 18000.00 | 13500.00          |

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR :

8- İTFALAR :

| Menkul Kıymet Türü | İtfa Tarihi | Nominal |
|--------------------|-------------|---------|
|--------------------|-------------|---------|

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 |
|------------------------|---------------|---------|-------------|--------------------|
|------------------------|---------------|---------|-------------|--------------------|