

YKP
(YDP) YAPI KREDİ PORTFOY PY ÜÇÜNCÜ DEĞİSKEN ÖZEL FON
MART 2020 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	:	745,163,428.66
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	29,234,878,322.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	20.07.2012
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.025489
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.025951
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	-1.78%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	-0.41%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	24.01%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		6.83%
Devlet Tahvili		41.70%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		14.93%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		3.17%
Kira Sertifikası-Kamu-YP		2.72%
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		13.19%
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		0.04%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		8.63%

Yabancı Hisse Senetleri	0.00%
VIOP Nakit Teminat	0.68%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	0.00%
Vadeli_YP	0.12%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	7.77%
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	0.22%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 60.80%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	26.55%
Devlet Borçlanma Senetleri	114.77%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 746.492
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 0.00
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	: 44,898,025.64

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
AKBNK	700,000.00	3,920,000.00	0.49
ASELS	100,000.00	2,360,000.00	0.29
BIMAS	61,000.00	3,059,150.00	0.38
EKGYO	1,900,000.00	2,223,000.00	0.28
ENKAI	0.54	3.38	0.00
EREGL	580,009.00	4,355,867.59	0.54
GARAN	550,000.00	4,471,500.00	0.55
GUSGR	1,000,000.00	2,170,000.00	0.27
HALKB	100,000.00	502,000.00	0.06
ISCTR	200,000.00	944,000.00	0.12
ISDMR	60,000.00	376,800.00	0.05
ISGYO	1.08	1.37	0.00
ISMEN	190,000.00	765,700.00	0.09
KAREL	60,000.00	798,000.00	0.10
KCHOL	175,000.00	2,350,250.00	0.29
KRDMD	800,000.00	1,520,000.00	0.19
ODAS	1.18	1.61	0.00
OTKAR	12,600.00	1,306,620.00	0.16
PETKM	350,000.00	1,060,500.00	0.13

PGSUS	10,500.00	359,100.00	0.04
SISE	500,000.53	2,070,002.20	0.26
SODA	325,000.02	1,657,500.09	0.21
SOKM	50,000.00	466,000.00	0.06
TCELL	295,000.00	3,634,400.00	0.45
THYAO	175,000.00	1,587,250.00	0.20
TKFEN	1.00	12.70	0.00
TOASO	41,500.00	682,675.00	0.08
TSKB	1,200,000.00	1,128,000.00	0.14
TTKOM	575,000.00	3,852,500.00	0.48
TUPRS	37,000.00	2,793,500.00	0.35
VAKBN	500,001.00	2,320,004.64	0.29
YATAS	160,000.00	838,400.00	0.10
YKBNK	1,350,000.32	2,551,500.60	0.32
TOPLAM	12,057,614.67	56,124,239.18	6.96
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI	:		
TRT030523T13	11,000,000.00	21,730,610.00	2.69
TRT080328T15	100,000.00	96,977.00	0.01
TRT110827T16	269,000.00	241,182.71	0.03
TRT120325T12	20,000.00	16,463.00	0.00
TRT120820T12	200,000.00	215,048.00	0.03
TRT140623T19	300,000.00	341,580.00	0.04
TRT140922T17	13,500,000.00	12,556,215.00	1.56
TRT160425T17	1,000,000.00	1,667,000.00	0.21
TRT170221T12	300,000.00	303,177.00	0.04
TRT170822T15	6,100,000.00	5,984,039.00	0.74
TRT180123T10	15,200,000.00	15,503,544.00	1.92
TRT200324T13	67,000.00	62,178.01	0.01
TRT201021T25	29,000,000.00	31,793,570.00	3.94
TRT210421T14	12,000,000.00	14,270,640.00	1.77
TRT220921T18	127,700,000.00	124,706,712.00	15.45
TRT240724T15	22,000.00	19,637.86	0.00
TRT261022T10	1,000,000.00	2,116,690.00	0.26
TOPLAM	217,778,000.00	231,625,263.58	28.70
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
TRT110226T13	55,000,000.00	50,732,550.00	6.29
TRT220921T18	-7,000,000.00	-6,850,620.00	-0.85
TOPLAM	48,000,000.00	43,881,930.00	5.44
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ	:		
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)	:		
E) DÖVİZE ENDEKSİLİ TAHVİLLER	:		
TRT171221F16	2,500,000.00	18,463,718.42	2.29
TOPLAM	2,500,000.00	18,463,718.42	2.29
F) FİNANSMAN BONOLARI	:		
TRFTCZB82013	3,550,000.00	3,602,007.50	0.45
TRFTISB52018	200,000.00	197,554.00	0.02
TOPLAM	3,750,000.00	3,799,561.50	0.47
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		

TRSARCL22117	12,720,000.00	12,889,684.80	1.60
TRSARCL72112	7,660,000.00	7,810,212.60	0.97
TRSAYGZ62110	2,800,000.00	2,777,012.00	0.34
TRSENSA72211	5,100,000.00	7,394,592.00	0.92
TRSERGL52117	2,900,000.00	2,914,848.00	0.36
TRSGRAN23013	4,900,000.00	4,983,496.00	0.62
TRSKCTY62012	1,000,000.00	1,040,230.00	0.13
TRSKFTF42016	3,050,000.00	3,261,395.50	0.40
TRSKFTF62113	360,000.00	362,437.20	0.04
TRSKRSNE2018	2,000,000.00	2,067,340.00	0.26
TRSOPAS22111	1,000,000.00	1,008,580.00	0.12
TRSOPAS22129	4,410,000.00	4,485,675.60	0.56
TRSOPAS42010	6,820,000.00	7,306,334.20	0.91
TRSOTKO32110	8,000,000.00	8,207,360.00	1.02
TRSTHALE2716	500,000.00	500,455.00	0.06
TRSTISB72712	5,140,000.00	5,246,757.80	0.65
TRSTISB92918	8,000,000.00	8,021,280.00	0.99
TRSTPRS12115	4,000,000.00	4,070,160.00	0.50
TRSTTRK42012	140,000.00	144,442.20	0.02
TRSVKFB92719	2,170,000.00	2,311,744.40	0.29
TRSYKBK62914	6,300,000.00	6,470,730.00	0.80
TRSYKBK92911	10,000,000.00	10,283,300.00	1.27
XS1629734879	2,350,000.00	2,443,776.75	0.30
TOPLAM	101,320,000.00	106,001,844.05	13.14
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
TRD260122T19	24,750,000.00	24,834,150.00	3.08
TRD290520F10	3,000,000.00	21,923,700.71	2.72
TOPLAM	27,750,000.00	46,757,850.71	5.79
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
İ) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
US900123CG37	11000000.00	60305643.20	7.47
TOPLAM	11,000,000.00	60,305,643.20	7.47
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TRT020823T11	8,186,195.00	16,504,091.10	2.05
TRT020823T11	12,651,410.00	25,506,357.53	3.16
TRT050624T19	3,452,235.00	3,500,867.81	0.43
TRT050624T19	493,185.00	500,124.66	0.06
TRT070727T13	9,378,840.00	13,503,365.75	1.67
TRT140421T13	575,295.00	500,124.66	0.06
TRT170822T15	20,980,535.00	20,004,936.99	2.48
TRT170822T15	20,980,565.00	20,004,964.38	2.48
TRT170822T15	20,980,570.00	20,004,969.86	2.48
TRT201021T25	18,842,900.00	20,004,936.99	2.48
TRT201021T25	18,842,945.00	20,004,986.30	2.48
TRT240724T15	7,536,280.00	6,501,620.55	0.81
TOPLAM	142,900,955.00	166,541,346.58	20.64

L) DİĞER	:			
GLDTRF		2,000,000.00	60,580,000.00	7.51
YPF		1,094,719.00	1,716,464.66	0.21
YSF		1,235,967.00	1,138,588.87	0.14
YPL		400,000.00	2,913,417.88	0.36
F_XAUTRYM0420		13,000.00	4,488,640.00	
F_XAUUSD0420		750.00	7,983,542.16	
BPP		257,064.43	257,064.43	0.03
TOPLAM			66,605,535.84	8.25
M) VARANT	:			
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:			
		5,110,129.22	5,110,129.22	0.63
TOPLAM		5,110,129.22	5,110,129.22	0.63
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
O) VDMK	:			
TRPTYV232410		1,500,000.00	1,727,460.00	0.21
TOPLAM		1,500,000.00	1,727,460.00	0.21
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU	:			
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	806,944,522.28		
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	5,308.76		
C. ALACAKLAR (+)	:	8,157,693.33		
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00		
E. BORÇLAR (-)	:	69,944,095.71		
FON TOPLAM DEĞERİ	:	745,163,428.66		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	:			
Açıklama			Tutarı	
37001 Fon Yönetim Ücreti		128,510.87		
37002 Denetim Ücreti		807.63		
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı		6,384.82		
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı		25,400.90		
370034 Yabancı Menkul Komisyonu		816.15		
37004 Aracılık Komisyonu		12,152.01		
37005 Vergi, Resim ve Harçlar		58.80		
37006 Saklama Giderleri		9,591.33		
37008 Banka Masrafları		698.38		
37010 Kap Gideri		326.70		
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu		205.22		
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti		11,048.22		
37023 VIOP İşlemi Komisyonu		55,863.56		
37028 Portföy Saklama Hizmeti		5,152.00		
37030 E-fatura Gideri		118.00		
37099 Diğer Giderler		611.00		
Toplam		257,745.59		

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

Açıklama	Giriş Tarihi	Stok	Kazanılan Nominal
OTKAR Tem :%833.33	23.03.2020	12600.00	105000.00
ISMEN Tem :%39.44	24.03.2020	190000.00	74929.58
TOASO Tem :%240.00	25.03.2020	41500.00	99600.00
KORDS Tem :%25.00	26.03.2020	74000.00	18500.00

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR :

8- İTFALAR :

Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal
TRSKCTY32015	04.03.2020	110000.00
TRSKCTF32014	23.03.2020	2000000.00

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