

YKP**(YBP) YAPI KREDİ PORTFOY PY BİRİNCİ DEĞİŞKEN ÖZEL FON****OCAK 2019 AYLİK RAPORUDUR.****1- FONU TANITICI BİLGİLER**

A. FONUN ADI	:	(YBP) YAPI KREDİ PORTFOY PY BİRİNCİ DEĞİŞKEN ÖZEL FON
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	30,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	116,585,417.19
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	105,786,950.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	10.08.1998
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	1.102077
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	1.073270
C. AYLİK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	2.68%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	2.68%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	26.10%
E. AYLİK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi	:	0.00%
Devlet Tahvili	:	33.59%
Hazine Bonosu	:	0.00%
Özel Sektör Tahvili	:	19.45%
Yapılandırılmış Ürünler	:	0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP	:	0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL	:	3.62%
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	:	1.90%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo	:	0.00%
Kuponlar Ters Repo	:	0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo	:	0.00%
Borsa Para Piyasası	:	3.87%
Kıymetli Madenler	:	0.00%
Yabancı Sabit Getirililer	:	0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)	:	35.72%
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	0.09%
Katılma Belgesi YP	0.00%
CC Swap	0.00%
FX Swap	0.00%
IR Swap	0.00%
VDMK	1.76%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 0.21%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	66.03%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 1307.325
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 0.00
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	: 0.00

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT010420T19	35,000.00	78,895.25	0.06
TRT050220T17	13,000,000.00	12,207,130.00	9.97
TRT080328T15	10,000,000.00	9,729,900.00	7.95
TRT110827T16	69,000.00	60,822.81	0.05
TRT140623T19	5,000,000.00	5,308,050.00	4.33
TRT140922T17	14,000.00	11,922.82	0.01
TRT150519T15	100,000.00	99,843.00	0.08
TRT170221T12	6,000,000.00	5,643,240.00	4.61
TRT170822T15	5,000,000.00	4,590,050.00	3.75
TRT180123T10	3,000,000.00	2,728,650.00	2.23
TRT220921T18	4,500,000.00	3,982,410.00	3.25
TRT240724T15	27,000.00	21,258.72	0.02
TRT270923T11	10,000.00	8,273.40	0.01
TOPLAM	46,755,000.00	44,470,446.00	36.32
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
TRT140623T19	-5,000,000.00	-5,300,500.00	-4.33
TRT140922T17	12,500,000.00	10,651,125.00	8.70
TRT220921T18	0.00	0.00	0.00
TOPLAM	7,500,000.00	5,350,625.00	4.37
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER			

F) FİNANSMAN BONOLARI	:			
TRFBOLU71910		500,000.00	451,885.00	0.37
TRFISFN31917		1,490,000.00	1,455,983.30	1.19
TRFOTKO41910		3,100,000.00	2,940,660.00	2.40
TRFYKFK41916		2,400,000.00	2,300,784.00	1.88
TOPLAM		7,490,000.00	7,149,312.30	5.84
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:			
TRSAKYP41612		428,128.00	450,138.06	0.37
TRSAYGZ12024		1,000,000.00	881,790.00	0.72
TRSIGY32111		910,000.00	923,185.90	0.75
TRSKCTY32015		160,000.00	166,392.00	0.14
TRSKFTF42016		1,150,000.00	1,121,572.00	0.92
TRSOPAS42010		1,500,000.00	1,563,780.00	1.28
TRSOTKO12013		1,500,000.00	1,663,800.00	1.36
TRSTIMG41917		900,000.00	910,143.00	0.74
TRSTISB72712		1,580,000.00	1,663,345.00	1.36
TRSTTRK42012		500,000.00	539,880.00	0.44
TRSVKFB92719		2,080,000.00	2,100,696.00	1.72
TOPLAM		11,708,128.00	11,984,721.96	9.79
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
H) KİRA SERTİFİKALARI	:			
TRD220921T16		2,960,000.00	4,160,161.60	3.40
TOPLAM		2,960,000.00	4,160,161.60	3.40
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
US900123AL40		1100000.00	7829353.80	6.39
US900123AW05		250000.00	1406760.62	1.15
US900123BD15		1000.00	5369.94	0.00
US900123BF62		1000000.00	5412431.56	4.42
US900123BH29		1362000.00	7306401.63	5.97
US900123BJ84		300000.00	1386346.92	1.13
US900123CG37		1000000.00	5096025.71	4.16
US900123CJ75		1400000.00	6506058.77	5.31
US900123CL22		1000000.00	5118771.29	4.18
US900123CM05		700000.00	3151844.13	2.57
TOPLAM		8,113,000.00	43,219,364.37	35.29
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
L) DİĞER	:			
YPL		191,985.00	1,042,176.95	0.85
BPP		1,533,813.70	1,521,048.92	1.24
BPP		1,007,232.88	1,004,592.63	0.82
BPP		14,008.94	14,008.94	0.01
BPP		474,304.53	474,304.53	0.39
TOPLAM			4,056,131.97	3.31
M) VARANT	:			
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:			

O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
O) VDMK	:			
TRPKYVFA2318		2,000,000.00	2,064,780.00	1.69
TOPLAM		2,000,000.00	2,064,780.00	1.69
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	122,455,543.19
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	4,251.38
C. ALACAKLAR (+)	:	23,004,945.05
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	28,429,184.37
FON TOPLAM DEĞERİ	:	116,585,417.19

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	9,747.19
37002 Denetim Ücreti	783.99
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	180.70
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	499.80
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	866.89
37006 Saklama Giderleri	3,548.34
37008 Banka Masrafları	635.36
37009 Noter Tasdik ve Ücreti	86.69
37010 Kap Gideri	337.75
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	1,841.15
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	1,977.89
37028 Portföy Saklama Hizmeti	2,969.75
37099 Diğer Giderler	159.60
Toplam	23,635.10

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

Açıklama	Giriş Tarihi	Stok	Kazanılan Nominal
----------	--------------	------	-------------------

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR

8- İTFALAR

Menkul Kıymet Türü	İtf Tarih	Nominal
TRFCLKM11919	08.01.2019	1350000.00
TRFYKFK11919	11.01.2019	1570000.00
TRFVKFK11915	15.01.2019	510000.00
TRFVFAS11919	18.01.2019	1000000.00
TRFGRFA11912	21.01.2019	860000.00
TRFYKFK11926	25.01.2019	3000000.00

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