

YKP
(YDP) YAPI KREDİ PORTFOY PY ÜÇÜNCÜ DEĞİSKEN ÖZEL FON
MART 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 AŞ
Ç. FON TUTARI	:	300,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	494,586,718.23
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	24,063,123,857.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	20.07.2012
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.020554
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.020923
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	-1.76%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	2.87%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	17.20%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		6.84%
Devlet Tahvili		40.72%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		23.58%
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%
Devlet Tahvili Ters Repo		11.99%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		3.37%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		1.10%
Yabancı Hisse Senetleri		0.00%
VIOP Nakit Teminat		1.33%

Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	0.73%
Vadeli_YP	3.57%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	5.45%
Katılma Belgesi YP	0.00%
CC Swap	0.00%
FX Swap	0.00%
IR Swap	0.00%
VDMK	1.30%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 48.15%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	31.68%
Devlet Borçlanma Senetleri	35.61%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 374.809
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 11,134,005.17
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	: 4,449,999.99

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
AKBNK	290,000.00	1,832,800.00	0.37
ARCLK	56,500.00	954,850.00	0.19
ASELS	80,000.00	1,702,400.00	0.34
BIMAS	26,500.00	2,019,300.00	0.40
ENKAI	60,000.54	275,402.49	0.05
EREGL	150,000.00	1,368,000.00	0.27
FROTO	11,049.00	538,970.22	0.11
GARAN	290,000.00	2,418,600.00	0.48
ISDMR	60,000.00	429,000.00	0.09
ISGYO	1.08	1.01	0.00
KAREL	80.00	555.20	0.00
KCHOL	145,000.00	2,333,050.00	0.47
KORDS	37,000.00	385,170.00	0.08
KRDMD	750,000.00	1,800,000.00	0.36
MGROS	43,500.00	589,860.00	0.12
ODAS	0.58	0.87	0.00
OTKAR	8,500.00	891,650.00	0.18
PETKM	240,000.00	1,089,600.00	0.22
PGSUS	69,000.00	1,876,800.00	0.37
SISE	0.53	3.10	0.00
SODA	260,000.02	1,950,000.13	0.39
TAVHL	20,500.00	478,470.00	0.10
TCELL	200,000.00	2,418,000.00	0.48

THYAO	175,000.00	2,262,750.00	0.45
TKFEN	30,000.00	676,200.00	0.13
TSKB	400,000.00	304,000.00	0.06
TTKOM	150,000.00	652,500.00	0.13
TUPRS	16,500.00	2,059,200.00	0.41
VAKBN	200,001.00	906,004.53	0.18
YKBNK	700,000.32	1,491,000.68	0.30
TOPLAM	4,469,133.07	33,704,138.23	6.72
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI	:		
TRT050220T17	30,300,000.00	27,187,887.00	5.42
TRT080328T15	100,000.00	74,415.00	0.01
TRT100719T18	6,000,000.00	5,875,740.00	1.17
TRT110226T13	20,000,000.00	13,932,200.00	2.78
TRT110827T16	269,000.00	178,524.54	0.04
TRT120325T12	20,000.00	12,118.20	0.00
TRT120820T12	25,200,000.00	26,302,248.00	5.25
TRT131119T19	18,500,000.00	18,343,305.00	3.66
TRT140623T19	300,000.00	271,308.00	0.05
TRT140922T17	5,000,000.00	3,502,800.00	0.70
TRT150120T16	18,200,000.00	17,032,106.00	3.40
TRT150519T15	4,400,000.00	4,517,700.00	0.90
TRT170221T12	29,800,000.00	24,953,030.00	4.98
TRT170822T15	6,100,000.00	4,588,237.00	0.92
TRT180123T10	700,000.00	550,284.00	0.11
TRT200324T13	67,000.00	48,022.92	0.01
TRT220921T18	52,200,000.00	39,900,636.00	7.96
TRT240724T15	22,000.00	14,858.36	0.00
TOPLAM	217,178,000.00	187,285,420.02	37.36
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ	:		
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)	:		
E) DÖVİZE ENDEKSİLİ TAHVİLLER	:		
F) FİNANSMAN BONOLARI	:		
TRFFFKR41936	2,200,000.00	2,189,088.00	0.44
TRFFNBK41934	3,000,000.00	2,968,830.00	0.59
TRFHLFK51918	3,000,000.00	2,931,930.00	0.58
TRFISFA41921	940,000.00	928,936.20	0.19
TRFISFN41916	5,000,000.00	4,986,900.00	0.99
TRFISFN41957	3,000,000.00	2,973,030.00	0.59
TRFISFN51923	8,000,000.00	7,741,200.00	1.54
TRFKCTY41914	1,600,000.00	1,596,560.00	0.32
TRFYKBK41915	3,000,000.00	2,981,130.00	0.59
TRFYKFK41916	1,350,000.00	1,343,250.00	0.27
TRFYKFK41924	5,000,000.00	4,952,200.00	0.99
TRFYKFK51915	1,650,000.00	1,618,782.00	0.32
TOPLAM	37,740,000.00	37,211,836.20	7.42
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSARCL22117	5,000,000.00	5,151,150.00	1.03

TRSAYGZ12024	1,000,000.00	922,960.00	0.18
TRSENSA72211	5,100,000.00	6,436,353.00	1.28
TRSKCTF32014	2,000,000.00	1,896,500.00	0.38
TRSKCTY62012	1,000,000.00	1,039,510.00	0.21
TRSKFTF42016	1,900,000.00	1,916,473.00	0.38
TRSKRSNE2018	2,000,000.00	2,053,020.00	0.41
TRSOPAS22111	1,000,000.00	1,006,010.00	0.20
TRSOPAS22129	4,200,000.00	4,307,226.00	0.86
TRSOPAS42010	5,320,000.00	5,682,877.20	1.13
TRSOTKO12013	5,000,000.00	5,170,850.00	1.03
TRSOTKO32110	6,000,000.00	6,055,740.00	1.21
TRSTHALE2716	500,000.00	504,510.00	0.10
TRSTIMGE1918	1,000,000.00	1,023,260.00	0.20
TRSTISB72712	5,010,000.00	5,152,133.70	1.03
TRSTPRS12115	4,000,000.00	4,183,720.00	0.83
TRSVKFB92719	2,010,000.00	2,023,205.70	0.40
XS1629734879	2,350,000.00	2,117,185.50	0.42
TOPLAM	54,390,000.00	56,642,684.10	11.30
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
XS1117601796	1000000.00	5698023.31	1.14
TOPLAM	1,000,000.00	5,698,023.31	1.14
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TRT050220T17	17,809,575.00	15,694,671.34	3.13
TRT060121T16	14,542,890.00	30,062,852.04	6.00
TRT081123T10	8,881,975.00	14,682,111.91	2.93
TRT110827T16	30,216,810.00	20,041,901.37	4.00
TRT120820T12	7,894,555.00	8,016,760.55	1.60
TRT131119T19	10,426,545.00	10,020,950.68	2.00
TOPLAM	89,772,350.00	98,519,247.89	19.65
L) DİĞER	:		
Forward EURO/TL	-1,500,000.00		
GLDTRf	1,250,000.00	26,465,000.00	5.28
YPF	1,094,719.00	1,544,960.50	0.31
YPL	400,000.00	2,369,139.90	0.47
Vadeli Mevduat YP gün 34	2,008,761.64	11,318,876.41	2.26
Vadeli Mevduat gün 14	11,000,000.00	11,067,901.84	2.21
F_XAUUSD0419	2,850.00	20,821,942.17	
BPP	487,022.60	487,022.60	0.10
TOPLAM		53,252,901.25	10.62
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		
	6,696,143.14	6,696,143.14	1.34
TOPLAM	6,696,143.14	6,696,143.14	1.34
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:		

VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
O) VDMK	:			
TRPKYVFA2318		5,500,000.00	5,716,315.00	1.14
TRPTYV232410		1,500,000.00	1,511,490.00	0.30
TOPLAM		7,000,000.00	7,227,805.00	1.44
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	501,341,450.39
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	3,188.41
C. ALACAKLAR (+)	:	1,044,375.00
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	7,802,295.57
FON TOPLAM DEĞERİ	:	494,586,718.23

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	85,713.60
37002 Denetim Ücreti	788.25
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	1,070.01
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	9,412.20
370033 Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	8,400.00
37004 Aracılık Komisyonu	7,908.52
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	9,640.56
37006 Saklama Giderleri	8,583.81
37008 Banka Masrafları	866.76
37010 Kap Gideri	264.43
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	266.65
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	8,664.90
37023 VIOP İşlemi Komisyonu	17,193.86
37028 Portföy Saklama Hizmeti	5,582.50
37030 E-fatura Gideri	118.00
37099 Diğer Giderler	146.94
Toplam	164,620.99

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

Açıklama	Giriş Tarihi	Stok	Kazanılan Nominal
TAVHL Tem :%208.54	20.03.2019	20500.00	42750.71
KORDS Tem :%35.00	25.03.2019	37000.00	12950.00
OTKAR Tem :%300.00	25.03.2019	7000.00	21000.00
TUPRS Tem :%1515.00	28.03.2019	12500.00	189375.00

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR

8- İTFALAR

Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal
TRFISFN31917	12.03.2019	3480000.00
TRSCLKM31910	15.03.2019	2000000.00
TRSORFN31910	15.03.2019	2400000.00
TRFYKYM31914	20.03.2019	10000000.00
TRSGFYH31914	25.03.2019	1360000.00
TRFISFN31933	28.03.2019	13660000.00
TRFAKYM31922	29.03.2019	4500000.00

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