

**YAPI KREDİ PORTFÖY BIST 30 ENDEKSİ  
HİSSE SENEDİ FONU (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON)**

**1 OCAK - 31 ARALIK 2020 DÖNEMİNE AİT  
PERFORMANS SUNUŞ RAPORU VE  
YATIRIM PERFORMANSI KONUSUNDA KAMUYA  
AÇIKLANAN BİLGİLERE İLİŞKİN RAPOR**



**YAPI KREDİ PORTFÖY BIST 30 ENDEKSİ  
HİSSE SENEDİ FONU (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON)**

**YATIRIM PERFORMANSI KONUSUNDA  
KAMUYA AÇIKLANAN BİLGİLERE İLİŞKİN RAPOR**

Yapı Kredi Portföy BIST 30 Endeksi Hisse Senedi Fonu (Hisse Senedi Yoğun Fon)'un ("Fon") 1 Ocak - 31 Aralık 2020 dönemine ait ekteki performans sunuş raporunu Sermaye Piyasası Kurulu'nun VII - 128.5 sayılı Bireysel Portföylerin ve Kolektif Yatırım Kuruluşlarının Performans Sunumuna, Performansa Dayalı Ücretlendirilmesine ve Kolektif Yatırım Kuruluşlarını Notlandırma ve Sıralama Faaliyetlerine İlişkin Esaslar Hakkında Tebliğ'inde ("Tebliğ") yer alan performans sunuş standartlarına ilişkin düzenlemeleri çerçevesinde incelemiş bulunuyoruz.

İncelememiz sadece yukarıda belirtilen döneme ait performans sunuşunu kapsamaktadır. Bunun dışında kalan dönemler için inceleme yapılmamış ve görüş oluşturulmamıştır.

Görüşümüze göre 1 Ocak - 31 Aralık 2020 dönemine ait performans sunuş raporu Fon'un performansını Tebliğ'de belirtilen performans sunuş standartlarına ilişkin düzenlemelere uygun olarak doğru bir biçimde yansıtmaktadır.

**Dikkat Çekilen Husus**

Sermaye Piyasası Kurulu'ndan alınan 8 Nisan 2020 tarih ve 12233903-305.01.01-E.4018 sayılı izin çerçevesinde; Fon, 29 Mayıs 2020 tarihi itibarıyla Yapı Kredi Portföy BIST 100 Endeksi Hisse Senedi Fonu (Hisse Senedi Yoğun Fon) ve Yapı Kredi Portföy BIST Temettü 25 Endeksi Hisse Senedi Fonu (Hisse Senedi Yoğun Fon) ile birleşmiştir.

**Diğer Husus**

Fon'un 31 Aralık 2020 tarihi itibarıyla kamuya açıklanmak üzere ayrıca hazırlanacak yıllık finansal tabloları üzerindeki bağımsız denetim çalışmalarımız henüz tamamlanmamış olup; söz konusu finansal tablolara ilişkin bağımsız denetim çalışmalarımızın tamamlanmasını müteakiben finansal tablolara ilişkin bağımsız denetçi raporumuz ayrıca tanzim edilecektir.

PwC Bağımsız Denetim ve  
Serbest Muhasebeci Mali Müşavirlik A.Ş.



İstanbul, 28 Ocak 2021



# YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş. TARAFINDAN KURULAN VE YÖNETİLEN YAPI KREDİ PORTFÖY BIST 30 ENDEKSİ HİSSE SENEDİ FONU (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON)

## 1 OCAK - 31 ARALIK 2020 DÖNEMİNE AİT PERFORMANS SUNUŞ RAPORU

### B. PERFORMANS BİLGİSİ

| Yıllar      | Toplam Getiri (%) | Karşılaştırma Ölçütünün Getirisi / Eşik Değer (%) | Enflasyon Oranı (%) (*) | Portföyün Zaman İçinde Standart Sapması (%) | Karşılaştırma Ölçütünün Standart Sapması/Eşik Değer (%) (**) | Bilgi Rasyosu | Sunuma Dahil Dönem Sonu Portföyün Net Aktif Değeri |
|-------------|-------------------|---|-------------------------|---|--|---------------|--|
| 2016        | 10.26             | 9.46  | 8.53                    | 1.23  | 1.20   | 0.0439        | 14,219,183.97                                      |
| 2017        | 50.23             | 44.82   | 11.92                   | 0.98  | 0.95   | 0.1537        | 11,830,973.26                                      |
| 2018 (***)  | -17.79            | -13.26  | 20.30                   | 1.34  | 1.30   | -0.2053       | 16,047,246.51                                      |
| 2019        | 25.75             | 25.83   | 11.84                   | 1.27  | 1.24   | 0.0026        | 19,167,122.71                                      |
| 2020 (****) | 16.10             | 18.93   | 14.60                   | 1.58  | 1.53   | -0.0683       | 252,633,858.05                                     |

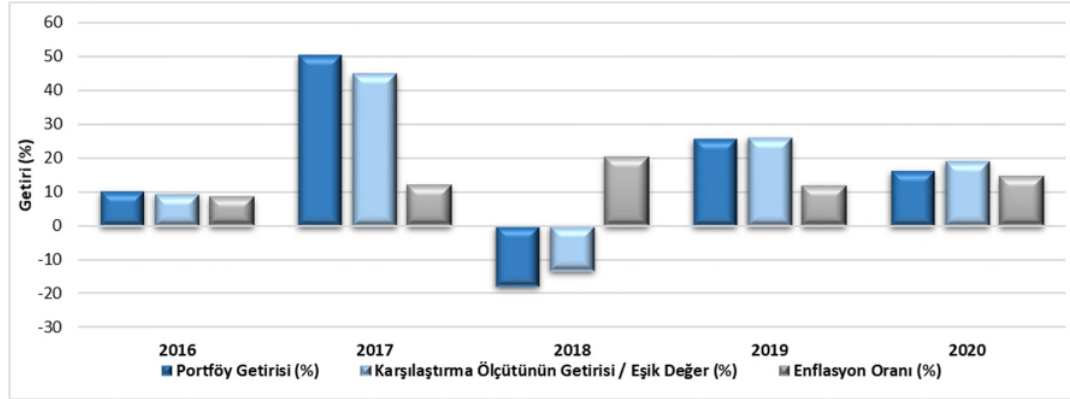
(\*) Enflasyon oranı TÜİK tarafından açıklanan TÜFE'nin performans dönemine denk gelen bileşik getirisidir.

(\*\*) Portföyün ve karşılaştırma ölçütünün standart sapması dönemdeki günlük getiriler üzerinden hesaplanmıştır.

(\*\*\*) Sermaye Piyasası Kurulu'nun i-SPK.52.4.o. (20 Haziran 2018 tarihli ve 26/740 s.k.) sayılı kararına istinaden Fon izahnamesinde belirlenen karşılaştırma ölçütü/eşik değer unsuruları arasında pay endeksi yer alan yatırım fonları tarafından karşılaştırma ölçütü/eşik değer getirisinin hesaplanmasında "pay fiyat endeksleri" değil, "pay getiri endeksleri" kullanılmıştır. Bu kapsamda, 1 Ocak - 31 Aralık 2018 dönemine ilişkin olarak yapılacak performans sunumlarından başlamak ve takip eden sunum dönemlerinde de uygulanmak üzere performans sunum raporlarında "pay getiri endeksleri" esas alınmıştır.

(\*\*\*\*) 1 Ocak - 31 Aralık 2020 tarihleri arasındaki dönemdir.

### GRAFİK



"PORTFÖYÜN GEÇMİŞ PERFORMANSI GELECEK DÖNEM PERFORMANSI İÇİN BİR GÖSTERGE OLAMAZ."

**YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş. TARAFINDAN KURULAN VE  
YÖNETİLEN YAPI KREDİ PORTFÖY BIST 30 ENDEKSİ HİSSE SENEDİ FONU  
(HİSSE SENEDİ YOĞUN FON)**

**1 OCAK - 31 ARALIK 2020 DÖNEMİNE AİT PERFORMANS SUNUŞ RAPORU**

**C. DİPNOTLAR**

1. Yapı Kredi Portföy Yönetimi A.Ş., portföy yönetimi ve yatırım danışmanlığı hizmeti veren bir portföy yönetim şirkettir. Yönetim alanları yatırım fonları, emeklilik fonları ve özel portföy yönetimidir. Kurucu, Fon'un katılma payı sahiplerinin haklarını koruyacak şekilde temsili, yönetimi, yönetiminin denetlenmesi ile faaliyetlerinin içtüzük ve izahname hükümlerine uygun olarak yürütülmesinden sorumludur. Kurucu fona ait varlıklar üzerinde kendi adına ve fon hesabına mevzuat ve içtüzüğe uygun olarak tasarrufta bulunmaya ve bundan doğan hakları kullanmaya yetkilidir. Fon'un faaliyetlerinin yürütülmesi esnasında portföy yöneticiliği hizmeti de dahil olmak üzere dışarıdan hizmet alınması, Kurucunun sorumluluğunu ortadan kaldırmaz. Fon portföyü, kolektif portföy yöneticiliğine ilişkin Portföy Yönetim Şirketleri Tebliği'nde belirtilen ilkeler ve fon portföyüne dahil edilebilecek varlık ve haklara ilişkin Tebliğ'de yer alan sınırlamalar çerçevesinde yönetilir.

Uzmanlaşılın Yönetim Alanları:

- Yatırım Fonu Portföy Yönetimi
  - Emeklilik Fonu Portföy Yönetimi
  - Özel Portföy Yönetimi
2. Fon portföyünün yatırım amacı ve yatırım stratejisine "A. Tanıtıcı Bilgiler" bölümünde yer verilmiştir.
  3. Fon Portföyü 1 Ocak 2020 - 31 Aralık 2020 sunum döneminde "net %16.10" oranında getiri sağlarken, karşılaştırma ölçütü getirisi aynı dönemde %18.93 olmuştur. Sonuç olarak Fon'un nispi getirisi %-2.83 olarak gerçekleşmiştir.

Toplam Getiri : Fonun ilgili dönemdeki birim pay değerindeki yüzdesel getiriyi ifade etmektedir.

Karşılaştırma Ölçütünün Getirisi : Fonun karşılaştırma ölçütünün ilgili dönem içerisinde belirtilen varlık dağılımları ile ağırlıklandırılarak hesaplanmış olan yüzdesel getirisini ifade etmektedir.

Nispi Getiri : Performans sonu dönemi itibarıyla hesaplanan portföy getiri oranı ile karşılaştırma ölçütünün getiri oranı arasındaki farkı ifade etmektedir.

4. Yönetim ücretleri, vergi, saklama ücretleri ve diğer faaliyet giderlerinin ortalama fon toplam değerine oranı aşağıdaki gibidir.

| 1 Ocak - 31 Aralık 2020 döneminde : | Ort. Fon Toplam<br>Değerine Oran (%) | TL Tutar              |
|-------------------------------------|--------------------------------------|-----------------------|
| Fon Yönetim Ücreti                  | 2.01                                 | 3,537,574.24          |
| Denetim Ücreti                      | 0.01                                 | 10,380.70             |
| Saklama Giderleri                   | 0.04                                 | 78,369.91             |
| İhraç İzni Giderleri                | -                                    | -                     |
| Noter Harç ve Tasdik Ücretleri      | 0.00                                 | 3,500.82              |
| Diğer Giderler                      | 0.22                                 | 389,716.37            |
| <b>Toplam Giderler</b>              | <b>2.29</b>                          | <b>4,019,542.04</b>   |
| <b>Ortalama Fon Toplam Değeri</b>   |                                      | <b>175,731,830.60</b> |

**YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş. TARAFINDAN KURULAN VE  
YÖNETİLEN YAPI KREDİ PORTFÖY BIST 30 ENDEKSİ HİSSE SENEDİ FONU  
(HİSSE SENEDİ YOĞUN FON)**

**1 OCAK - 31 ARALIK 2020 DÖNEMİNE AİT PERFORMANS SUNUŞ RAPORU**

**C. DİPNOTLAR (Devamı)**

|  |       |
|--|-------|
| <b>Fon Net Getiri</b>                              | 16.10 |
| <b>Gerçekleşen Gider Oranı*</b>                    | 1.99  |
| <b>Azami Gider Oranı</b>                           | 2.19  |
| <b>Kurucu Tarafından Karşılana n Gider Oranı**</b> | 0.03  |
| <b>Net Gider Oranı</b>                             | 1.99  |
| <b>Fon Brüt Getiri</b>                             | 18.09 |

(\*) Fondan A grubu ve B grubu pay sahipleri için farklı yönetim ücreti kesilmekte olup, gerçekleşen gider oranına, B grubu paylara yapılan yönetim ücreti iadelerinin toplam giderden düşülmesi ile ulaşılmaktadır.

(\*\*) Fon'un gerçekleşen gider oranının azami fon toplam gider oranını aşmış olması durumunda, dönem içinde fon toplam gider oranını aşan kısım kurucu tarafından karşılanarak fona ödenmiştir.

5. Performans sunum döneminde yatırım stratejisi değişikliği yapılmamıştır.

6. Yatırım fonlarının portföy işletmesinden doğan kazançları kurumlar vergisi ve stopajdan muaftır.

7. 29 Mayıs 2020 tarihinde Sermaye Piyasası Kurulu'ndan alınan 8 Nisan 2020 tarih ve 12233903-305.01.01-E.4018 sayılı yazı ile (YAU) Yapı Kredi Portföy BIST 100 Endeksi Hisse Senedi Fonu (Hisse Senedi Yoğun Fon) ve (YDE) Yapı Kredi Portföy BIST Temettü 25 Endeksi Hisse Senedi Fonu (Hisse Senedi Yoğun Fon) varlıkları sona ererek, (YEF) Yapı Kredi Portföy BIST 30 Endeksi Hisse Senedi Fonu (Hisse Senedi Yoğun Fon) bünyesinde birleşmiştir.

**D. İLAVE BİLGİLER ve AÇIKLAMALAR**

1. Getiri Oranını Etkileyen Piyasa Koşulları

| <b>1 Ocak 2020 - 31 Aralık 2020 döneminde :</b>       | <b>Getiri</b> |
|---|---------------|
| <b>BIST 100 Getiri Endeksi</b>                        | 30.85%        |
| <b>BIST 30 Getiri Endeksi</b>                         | 19.33%        |
| <b>BIST-KYD REPO BRÜT ENDEKSİ</b>                     | 11.64%        |
| <b>BIST-KYD DİBS 91 GÜN ENDEKSİ</b>                   | 9.92%         |
| <b>BIST-KYD DİBS 182 GÜN ENDEKSİ</b>                  | 8.94%         |
| <b>BIST-KYD DİBS 365 GÜN ENDEKSİ</b>                  | 8.30%         |
| <b>BIST-KYD DİBS 547 GÜN ENDEKSİ</b>                  | 7.70%         |
| <b>BIST-KYD DİBS TÜM ENDEKSİ</b>                      | 8.49%         |
| <b>BIST-KYD DİBS UZUN ENDEKSİ</b>                     | 9.61%         |
| <b>BIST-KYD ÖSBA SABİT ENDEKSİ</b>                    | 11.41%        |
| <b>BIST-KYD ÖSBA DEĞİŞKEN ENDEKSİ</b>                 | 13.53%        |
| <b>BIST-KYD Kamu Kira Sertifikaları Endeksi</b>       | 8.81%         |
| <b>BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Mevduat Endeksi (TL)</b> | 9.77%         |
| <b>BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Kar Payı TL Endeksi</b>  | 8.87%         |
| <b>Katılım 50 Getiri Endeksi</b>                      | 92.44%        |
| <b>BIST-KYD ALTIN FİYAT AĞIRLIKLIL ORTALAMA</b>       | 55.13%        |
| <b>BIST-KYD Eurobond USD (TL)</b>                     | 38.47%        |
| <b>BIST-KYD Eurobond EUR (TL)</b>                     | 44.54%        |
| <b>Dolar Kuru</b>                                     | 24.91%        |
| <b>Euro Kuru</b>                                      | 36.84%        |