

YKP
(YHT) YAPI KREDİ PORTFOY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
HAZİRAN 2018 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	(YHT) YAPI KREDİ PORTFOY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	387,343,250.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	848,851,281.51
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	14,808,262,438.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	31.07.2002
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.057323
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.056741
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.03%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	5.96%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	11.84%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		2.98%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		79.66%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		0.04%
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		3.54%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		4.41%
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	9.37%
Vadeli_YP	0.00%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	0.00%
Katılma Belgesi YP	0.00%
CC Swap	0.00%
VDMK	0.00%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	33.85%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	29.20%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	59.522
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	821,041,873.10
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	581,416,966.06

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT160119T18	5,738,000.00	5,241,663.00	0.62
TRT200219T11	10,000,000.00	15,186,700.00	1.79
TOPLAM	15,738,000.00	20,428,363.00	2.40
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFAKBK71813	40,000,000.00	39,863,200.00	4.69
TRFAKFK81821	15,000,000.00	14,746,950.00	1.73
TRFCLKM71814	5,900,000.00	5,872,860.00	0.69
TRFDFKT91817	2,900,000.00	2,819,061.00	0.33
TRFFFKR11913	3,000,000.00	2,760,240.00	0.32
TRFFFKR81817	4,000,000.00	3,912,920.00	0.46
TRFFIBA71817	5,000,000.00	4,996,050.00	0.59
TRFFIBA71825	6,680,000.00	6,638,584.00	0.78
TRFFIBA81832	8,000,000.00	7,860,080.00	0.92
TRFFIBA91815	3,140,000.00	3,057,543.60	0.36
TRFFIBA91823	3,000,000.00	2,904,180.00	0.34
TRFFIBAE1827	10,000,000.00	9,504,600.00	1.12
TRFFINF71811	5,000,000.00	4,965,350.00	0.58
TRFFNBK81823	10,000,000.00	9,877,400.00	1.16
TRFFNBK81831	7,500,000.00	7,386,975.00	0.87
TRFFNBK81849	18,100,000.00	17,778,544.00	2.09

TRFFNBK91830	6,700,000.00	6,458,465.00	0.76
TRFGRAN71811	10,000,000.00	9,934,000.00	1.17
TRFGRAN71829	30,000,000.00	29,680,200.00	3.49
TRFGRAN91819	20,500,000.00	19,997,750.00	2.35
TRFGRFA81816	5,450,000.00	5,372,174.00	0.63
TRFGRFAK1815	16,200,000.00	15,346,746.00	1.81
TRFGRFKK1813	4,550,000.00	4,334,057.00	0.51
TRFHALK71818	10,000,000.00	9,965,100.00	1.17
TRFHALK71826	10,000,000.00	9,910,900.00	1.17
TRFHLLFK71817	5,000,000.00	4,968,800.00	0.58
TRFHLLGY91814	8,250,000.00	7,997,715.00	0.94
TRFISFA91819	11,500,000.00	11,222,850.00	1.32
TRFISFN11927	6,590,000.00	6,076,441.30	0.71
TRFISFN71814	10,000,000.00	9,957,900.00	1.17
TRFISFN91812	12,000,000.00	11,651,040.00	1.37
TRFISFN91820	10,000,000.00	9,690,500.00	1.14
TRFISFN91838	2,590,000.00	2,504,322.80	0.29
TRFISFNK1817	6,000,000.00	5,708,220.00	0.67
TRFISGY71819	2,320,000.00	2,300,210.40	0.27
TRFISMD71829	15,000,000.00	14,853,750.00	1.75
TRFISMD71837	20,000,000.00	19,862,800.00	2.34
TRFISMD81893	5,000,000.00	4,931,500.00	0.58
TRFISMD818A0	10,000,000.00	9,851,800.00	1.16
TRFISMDA1812	5,000,000.00	4,680,350.00	0.55
TRFISMDE1826	5,000,000.00	4,736,250.00	0.56
TRFNURL71819	3,750,000.00	3,726,600.00	0.44
TRFSKBK71815	8,500,000.00	8,483,255.00	1.00
TRFTCZB71818	20,000,000.00	19,969,600.00	2.35
TRFTCZB71826	20,000,000.00	19,969,600.00	2.35
TRFTCZB81825	10,000,000.00	9,778,500.00	1.15
TRFTEBK71816	30,000,000.00	29,965,800.00	3.52
TRFTEBK71824	10,000,000.00	9,961,800.00	1.17
TRFTEBK81815	10,000,000.00	9,881,200.00	1.16
TRFTEBKE1815	20,000,000.00	19,046,800.00	2.24
TRFTHAL71827	25,000,000.00	24,893,750.00	2.93
TRFVFAS71814	5,000,000.00	4,984,350.00	0.59
TRFVKFB71827	9,000,000.00	8,914,590.00	1.05
TRFVKFB91833	10,000,000.00	9,691,700.00	1.14
TRFYKBK81820	10,000,000.00	9,825,000.00	1.16
TRFYKBK81846	5,000,000.00	4,941,300.00	0.58
TRFYKBK91811	15,000,000.00	14,614,800.00	1.72
TRFYKFK81813	10,000,000.00	9,813,800.00	1.15
TRFYKFK81821	5,000,000.00	4,875,700.00	0.57
TRFYKFKE1816	4,000,000.00	3,822,560.00	0.45
TRFYKFKE1824	10,000,000.00	9,574,700.00	1.13
TRFYKYM71811	10,000,000.00	9,965,200.00	1.17
TRFYKYM71829	5,000,000.00	4,969,100.00	0.58
TRFYKYM81810	18,000,000.00	17,717,760.00	2.08
TOPLAM	668,120,000.00	656,325,844.10	77.20

VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:			
TRSGFYH31914		4,530,000.00	4,547,938.80	0.53
TRSIGY32111		4,550,000.00	4,586,809.50	0.54
TRSKFTF42016		4,200,000.00	4,304,958.00	0.51
TRSOPAS22111		9,000,000.00	9,239,220.00	1.09
TRSOPAS42010		5,000,000.00	5,144,400.00	0.61
TRSRNSH22023		5,000,000.00	5,103,350.00	0.60
TRSTISB72712		5,000,000.00	5,155,250.00	0.61
TRSVKFB92719		5,000,000.00	5,036,050.00	0.59
TOPLAM		42,280,000.00	43,117,976.30	5.07
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
H) KİRA SERTİFİKALARI	:			
TRD130219T18		150,000.00	151,741.50	0.02
TRD260918T17		280,000.00	281,103.20	0.03
TOPLAM		430,000.00	432,844.70	0.05
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
TRT230222T13		282,635.00	472,595.11	0.06
TRT230222T13		11,976,048.00	20,029,342.47	2.36
TOPLAM		12,258,683.00	20,501,937.58	2.41
L) DİĞER	:			
Vadeli Mevduat gün 34		19,000,000.00	19,110,412.78	2.25
Vadeli Mevduat gün 34		19,000,000.00	19,110,978.45	2.25
Vadeli Mevduat gün 46		19,500,000.00	19,613,251.21	2.31
Vadeli Mevduat gün 46		17,000,000.00	17,099,989.16	2.01
BPP		21,510,849.32	21,168,000.13	2.49
BPP		3,226,627.40	3,179,363.89	0.37
BPP		10,050,958.90	10,035,492.64	1.18
TOPLAM			109,317,488.26	12.86
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	:	850,124,453.94		
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	509,882.44		
C. ALACAKLAR (+)	:	20,221.61		
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00		
E. BORÇLAR (-)	:	1,803,276.48		
FON TOPLAM DEĞERİ	:	848,851,281.51		

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

:

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	1,718,511.32
37002 Denetim Ücreti	440.20
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	1,985.49
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	10,711.62
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	3,145.44
37006 Saklama Giderleri	20,341.01
37008 Banka Masrafları	1,180.41
37010 Kap Gideri	246.45
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	7,418.44
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	8,214.35
37028 Portföy Saklama Hizmeti	2,604.00
37030 E-fatura Gideri	169.57
37098 Küsürat farkları	1.06
37099 Diğer Giderler	245.52
Toplam	1,775,214.88

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

:

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

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR

:

8- İTFALAR

:

Menkul Kıymet Türü	İtfı Tarihi	Nominal
TRFGRAN61812	01.06.2018	25000000.00
TRFGRAN61838	01.06.2018	20000000.00
TRFYKFK61815	05.06.2018	4900000.00
TRFVFAS61815	06.06.2018	7030000.00
TRFNURL61810	07.06.2018	5000000.00
TRFYKFK61823	07.06.2018	8000000.00
TRFISFN61815	08.06.2018	3000000.00
TRFGRAN61846	11.06.2018	5000000.00
TRFGRFA61826	19.06.2018	10000000.00
TRFGRAN61853	22.06.2018	10000000.00
TRFALFK61813	25.06.2018	5250000.00
TRFISMD61853	26.06.2018	5000000.00
TRFFIBA61818	27.06.2018	10000000.00
TRFAKYM61838	29.06.2018	11600000.00
TRFHLFK61818	29.06.2018	14600000.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR

: