

YKP
(YTP) YAPI KREDİ PORTFOY DORDUNCU DEĞİSKEN FON
NİSAN 2018 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	(YTP) YAPI KREDİ PORTFOY DORDUNCU DEĞİSKEN FON
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFOY YONETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	200,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	48,293,568.51
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	3,605,699,525.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	01.07.2014
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.013394
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.013751
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	-2.60%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	-1.75%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	6.30%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		22.57%
Devlet Tahvili		2.37%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		32.88%
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		1.44%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		11.60%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		5.87%
Yabancı Hisse Senetleri		0.00%
VIOP Nakit Teminat		3.22%

Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	6.75%
Vadeli_YP	2.70%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	2.71%
Katılma Belgesi YP	6.22%
CC Swap	0.00%
VDMK	1.68%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	8.17%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	96.44%
Devlet Borçlanma Senetleri	153.03%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	205.258
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	15,855,345.25
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	3,461,870.45

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
AKSEN	50,000.00	207,500.00	0.37
ASELS	75,000.00	1,890,000.00	3.41
DGATE	50,000.00	445,500.00	0.80
DGKLB	225,000.00	625,500.00	1.13
EREGL	75,000.00	762,000.00	1.37
ISGYO	0.55	0.67	0.00
KAREL	375,000.00	2,561,250.00	4.62
KRDMD	875,000.18	3,561,250.71	6.42
MAVI	12,500.00	610,000.00	1.10
ODAS	275,000.00	1,672,000.00	3.02
PEKGY	75,000.00	606,750.00	1.09
SODA	0.86	4.17	0.00
THYAO	75,000.00	1,253,250.00	2.26
TOPLAM	2,162,501.59	14,195,005.56	25.61
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT080720T19	63,000.00	59,604.30	0.11
TRT110827T16	69,000.00	64,259.70	0.12
TRT120325T12	27,000.00	21,905.91	0.04
TRT150120T16	3,000.00	2,945.28	0.01
TRT240724T15	14,000.00	12,365.36	0.02
TRT270923T11	2,000.00	1,720.72	0.00
TOPLAM	178,000.00	162,801.27	0.29
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
TRT080328T15	6,000,000.00	6,143,760.00	11.08
TOPLAM	6,000,000.00	6,143,760.00	11.08

C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ	:			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)	:			
E) DÖVİZE ENDEKSİ TAHVİLLER	:			
F) FİNANSMAN BONOLARI	:			
TRFDFKT91817		500,000.00	473,500.00	0.85
TRFGRAN91819		1,000,000.00	953,060.00	1.72
TRFNURL91817		1,000,000.00	951,480.00	1.72
TRFVDTF51818		1,000,000.00	994,890.00	1.79
TRFYAKF91813		1,000,000.00	950,300.00	1.71
TOPLAM		4,500,000.00	4,323,230.00	7.80
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:			
TRSAKYP41612		342,500.00	360,107.93	0.65
TRSCCLKM31910		1,500,000.00	1,532,070.00	2.76
TRSDGOZ71918		160,000.00	160,000.00	0.29
TRSDOGH31910		630,000.00	643,538.70	1.16
TRSENSA72211		1,000,000.00	1,093,590.00	1.97
TRISFN91815		1,000,000.00	1,018,160.00	1.84
TRSKRSNE2018		500,000.00	505,905.00	0.91
TRSOPAS22111		700,000.00	719,341.00	1.30
TRSORFN31910		1,000,000.00	882,870.00	1.59
TRSSRTNE1912		500,000.00	504,985.00	0.91
TRSTBTF31928		300,000.00	264,207.00	0.48
TRSTBTF51819		1,500,000.00	1,541,745.00	2.78
TRSTISB72712		1,000,000.00	1,039,890.00	1.88
TRSYDAT71814		500,000.00	501,845.00	0.91
XS1629734879		650,000.00	656,467.50	1.18
TOPLAM		11,282,500.00	11,424,722.13	20.61
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
H) KİRA SERTİFİKALARI	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
ASHR.K		13220.00	1598432.41	2.88
EEM		9850.00	1887541.87	3.40
XS0987355939		800000.00	3248386.63	5.86
TOPLAM		823,070.00	6,734,360.92	12.15
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
L) DİĞER	:			
Forward EURO/TL		-306,750.00		
Forward USD/TL		-20,000.00		
Forward USD/TL		-820,000.00		
YPK		1,182,948.00	1,545,098.07	2.79
Vadeli Mevduat YP gün 41		306,750.00	1,504,064.35	2.71
Vadeli Mevduat gün 41		1,500,000.00	1,524,241.70	2.75
Vadeli Mevduat gün 41		1,300,000.00	1,321,009.47	2.38
Vadeli Mevduat gün 41		1,000,000.00	1,016,161.13	1.83
F_USDTRY0618		-850.00	-3,508,460.00	

F_XAUUSD0618	800.00	4,272,224.32	
F_XU0300618	-1,075.00	-13,875,562.50	
BPP	2,668,965.54	2,668,965.54	4.81
TOPLAM		9,579,540.26	17.28
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		
	1,915,401.47	1,915,401.47	3.46
TOPLAM	1,915,401.47	1,915,401.47	3.46
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
O) VDMK	:		
TRPAK5F81818	1,000,000.00	957,200.00	1.73
TOPLAM	1,000,000.00	957,200.00	1.73
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	55,436,021.60
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	4,650.79
C. ALACAKLAR (+)	:	182,897.20
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	6,809,893.15
FON TOPLAM DEĞERİ	:	48,293,568.51

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	67,146.30
37002 Denetim Ücreti	426.00
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	317.49
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	154.47
37004 Aracılık Komisyonu	4,746.24
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	996.34
37006 Saklama Giderleri	891.22
37008 Banka Masrafları	92.02
37010 Kap Gideri	238.50
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	4,427.33
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	3,353.91
37023 VIOP İşlemi Komisyonu	50,822.19
37028 Portföy Saklama Hizmeti	1,995.00
37030 E-fatura Gideri	164.10
37098 Küsürat farkları	0.01
37099 Diğer Giderler	237.60
Toplam	136,008.72

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

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

ENJSA Tem :%30.00	03.04.2018	50000.00	15000.00
-------------------	------------	----------	----------

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR :

8- İTFAALAR :

Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal
TRFGVYA41813	13.04.2018	500000.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR :