

YKP
(YOD) YAPI KREDİ PORTFOY İKİNCİ DEĞİSKEN FON
MAYIS 2018 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	(YOD) YAPI KREDİ PORTFOY İKİNCİ DEĞİSKEN FON
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFOY YONETİMİ A.S.
Ç. FON TUTARI	:	250,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	66,554,468.30
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	4,251,167,395.75
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	30.12.2010
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.015656
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.016001
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	-2.16%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	-6.18%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	-0.67%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		29.27%
Devlet Tahvili		1.18%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		41.78%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		0.11%
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		0.43%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		5.95%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		6.28%
Yabancı Hisse Senetleri		0.00%
VIOP Nakit Teminat		3.45%

Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	5.83%
Vadeli_YP	2.97%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	2.18%
Katılma Belgesi YP	0.56%
CC Swap	0.00%
VDMK	0.00%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	4.44%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	223.73%
Devlet Borçlanma Senetleri	112.89%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	260.238
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	11,955,601.13
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	277,223.53

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
ADANA	0.56	3.54	0.00
AKBNK	0.65	5.20	0.00
ALARK	0.01	0.05	0.00
ANHYT	0.40	3.28	0.00
ANSGR	0.84	3.77	0.00
ASELS	175,000.00	4,130,000.00	6.42
DGATE	50,000.00	269,500.00	0.42
DGGYO	0.97	2.66	0.00
DOHOL	0.38	0.36	0.00
ENKAI	1.07	4.76	0.00
EREGL	0.99	11.15	0.00
GARAN	125,000.00	1,113,750.01	1.73
HURGZ	0.12	0.15	0.00
ICBCT	75,000.00	375,750.00	0.58
ISCTR	0.66	3.94	0.00
ISFIN	0.79	2.05	0.00
ISGYO	1.07	1.07	0.00
KAREL	525,000.00	3,186,750.00	4.96
KCHOL	0.88	12.27	0.00
KRDMD	250,000.30	1,190,001.43	1.85
MAVI	37,500.00	1,827,000.00	2.84
ODAS	375,000.00	1,638,750.00	2.55
PEKGY	130,000.00	741,000.00	1.15
PETKM	0.75	3.52	0.00
QNBFB	0.29	1.32	0.00

SAHOL	0.14	1.30	0.00
SISE	0.19	0.77	0.00
SKBNK	0.71	0.90	0.00
SNGYO	1.00	0.63	0.00
SODA	0.59	3.14	0.00
TCELL	0.97	11.63	0.00
THYAO	125,000.19	2,081,253.23	3.24
TKFEN	0.08	1.14	0.00
TOASO	0.44	11.03	0.00
TRKCM	0.36	1.45	0.00
VAKBN	0.16	0.88	0.00
YKBNK	250,000.45	1,005,001.81	1.56
TOPLAM	2,117,516.01	17,558,848.41	27.31
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ	:		
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)	:		
E) DÖVİZE ENDEKSİLİ TAHVİLLER	:		
F) FİNANSMAN BONOLARI	:		
TRFDFKT91817	500,000.00	479,630.00	0.75
TRFGRAN91819	1,500,000.00	1,446,045.00	2.25
TRFNURL91817	1,000,000.00	962,720.00	1.50
TRFYAKF91813	2,025,000.00	1,946,774.25	3.03
TOPLAM	5,025,000.00	4,835,169.25	7.52
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSAFKK1910	2,000,000.00	2,391,200.00	3.72
TRSAZEV21919	100,000.00	102,381.00	0.16
TRSDGOZ71918	400,000.00	400,000.00	0.62
TRSDOGH31910	1,010,000.00	1,045,299.50	1.63
TRSENSA72211	1,000,000.00	1,108,440.00	1.72
TRSICICE1818	2,092,000.00	2,147,082.36	3.34
TRSISFN91815	1,500,000.00	1,545,600.00	2.40
TRSKCTF32014	1,000,000.00	1,027,610.00	1.60
TRSKRSNE2018	1,000,000.00	1,026,480.00	1.60
TRSNLOG21912	900,000.00	907,461.00	1.41
TRSOPAS42010	2,000,000.00	2,031,600.00	3.16
TRSORFN31910	1,500,000.00	1,339,995.00	2.08
TRSOTKO22012	1,500,000.00	1,557,135.00	2.42
TRSRNSH11919	800,000.00	814,088.00	1.27
TRSSRTNA1817	500,000.00	518,810.00	0.81
TRSSRTNE1912	1,000,000.00	1,024,140.00	1.59
TRSTBTF31928	500,000.00	445,620.00	0.69
TRSTHALE2716	500,000.00	508,175.00	0.79
TRSTISB72712	1,000,000.00	1,016,280.00	1.58
TRSYDAT71814	1,300,000.00	1,322,802.00	2.06
XS1629734879	1,350,000.00	1,315,311.75	2.05
TOPLAM	22,952,000.00	23,595,510.61	36.69
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		

H) KİRA SERTİFİKALARI	:			
TRD140721T18		80,000.00	72,396.80	0.11
TOPLAM		80,000.00	72,396.80	0.11
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
XS0987355939		500000.00	2249182.37	3.50
XS1057541838		500000.00	2238226.81	3.48
TOPLAM		1,000,000.00	4,487,409.18	6.98
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
L) DİĞER	:			
Forward EURO/TL		-400,000.00		
Forward USD/TL		-512,500.00		
Forward USD/TL		-12,812.00		
Forward USD/TL		-500,000.00		
YPK		1,182,948.00	1,529,457.13	2.38
Vadeli Mevduat YP gün 46		400,000.00	2,100,987.24	3.27
Vadeli Mevduat gün 49		2,000,000.00	2,023,580.96	3.15
Vadeli Mevduat gün 49		2,000,000.00	2,023,738.57	3.15
F_XU0300618		-375.00	-4,665,937.50	
BPP		3,689,717.70	3,689,717.70	5.74
TOPLAM			11,367,481.60	17.68
M) VARANT	:			
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:			
		2,388,803.66	2,388,803.66	3.71
TOPLAM		2,388,803.66	2,388,803.66	3.71
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
O) VDMK	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU	:			
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	64,305,619.51		
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	10,708.67		
C. ALACAKLAR (+)	:	4,149,972.07		
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00		
E. BORÇLAR (-)	:	1,511,831.95		
FON TOPLAM DEĞERİ	:	66,554,468.30		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	:			
Açıklama		Tutarı		
37001 Fon Yönetim Ücreti		146,709.48		
37002 Denetim Ücreti		138.90		
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı		549.74		
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı		67.41		
370034 Yabancı Menkul Komisyonu		2,155.26		
37004 Aracılık Komisyonu		19,333.00		

37005	Vergi, Resim ve Harçlar	555.05
37006	Saklama Giderleri	1,279.84
37008	Banka Masrafları	74.72
37010	Kap Gideri	253.50
37015	Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	3,106.07
37021	Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	1,165.29
37023	VIOP İşlemi Komisyonu	76,649.35
37028	Portföy Saklama Hizmeti	1,862.00
37030	E-fatura Gideri	164.10
37098	Küsürat farkları	1.41
37099	Diğer Giderler	237.60
Toplam		254,302.72

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

Açıklama	Giriş Tarihi	Stok	Kazanılan Nominal
PETKM Tem :%36.00	03.05.2018	0.75	0.27
ISGYO Bds :%4.92	04.05.2018	1.02	0.05
ENKAI Bds :%8.70	24.05.2018	0.98	0.09
ISFIN Bds :%6.92	28.05.2018	0.74	0.05
DGATE Tem :%40.00	29.05.2018	50000.00	20000.00
EREGL Tem :%84.00	29.05.2018	0.99	0.83
MAVI Tem :%52.20	29.05.2018	32500.00	16966.46
SODA Tem :%25.00	30.05.2018	0.59	0.15
SISE Tem :%13.33	31.05.2018	0.19	0.03
TRKCM Tem :%15.04	31.05.2018	0.36	0.05

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR :

8- İTFALAR :

Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal
--------------------	-------------	---------

9- PORTFÖYE ALIŞLAR :