

**YKP**  
**(YTP) YAPI KREDİ PORTFOY DORDUNCU DEĞİSKEN FON**  
**MAYIS 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.S.               |
| Ç. FON TUTARI                     | : | 200,000,000.00                                 |
| D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ | : | 40,651,080.16                                  |
| E. KATILMA PAYI SAYISI            | : | 3,102,641,434.00                               |
| F. FONUN KURULUŞ TARİHİ           | : | 01.07.2014                                     |
| G. FONUN SÜRESİ                   | : | Süresiz                                        |

**2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER**

|                                                        |   |          |
|--------------------------------------------------------|---|----------|
| A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI                         | : | 0.013102 |
| B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI                       | : | 0.013394 |
| C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI               | : | -2.18%   |
| Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI                    | : | -3.89%   |
| D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI              | : | 2.75%    |
| E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ | : |          |
| Hisse Senedi                                           |   | 31.01%   |
| Devlet Tahvili                                         |   | 1.59%    |
| Hazine Bonosu                                          |   | 0.00%    |
| Özel Sektör Tahvili                                    |   | 30.15%   |
| 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                               |   | 0.00%    |
| Özel Sek. Tahvili Ters Repo                            |   | 0.00%    |
| Kuponlar Ters Repo                                     |   | 0.00%    |
| Hazine Bonosu Ters Repo                                |   | 0.00%    |
| Borsa Para Piyasası                                    |   | 13.58%   |
| Kıymetli Madenler                                      |   | 0.00%    |
| Yabancı Sabit Getirililer                              |   | 0.00%    |
| Euro Bond (Euro Tahvil Türk)                           |   | 4.54%    |
| Yabancı Hisse Senetleri                                |   | 0.00%    |
| VIOP Nakit Teminat                                     |   | 3.10%    |

|                                                           |              |
|-----------------------------------------------------------|--------------|
| Varant                                                    | 0.00%        |
| Forward                                                   | 0.00%        |
| Vadeli_TL                                                 | 6.87%        |
| Vadeli_YP                                                 | 2.97%        |
| Opsiyon APG                                               | 0.00%        |
| Opsiyon                                                   | 0.00%        |
| Katılma Belgesi                                           | 3.47%        |
| Katılma Belgesi YP                                        | 0.55%        |
| CC Swap                                                   | 0.00%        |
| VDMK                                                      | 2.16%        |
| F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI                           | 6.67%        |
| G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI                      |              |
| Hisse Senedi                                              | 247.75%      |
| Devlet Borçlanma Senetleri                                | 118.23%      |
| Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ                              | 185.880      |
| H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ | 7,144,021.07 |
| I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI  | 506,133.76   |

### 3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

|                                          | Nominal Değeri | Rayiç Değeri  | %     |
|------------------------------------------|----------------|---------------|-------|
| A) HİSSE SENETLERİ                       |                |               |       |
| ASELS                                    | 125,000.00     | 2,950,000.00  | 7.57  |
| DGATE                                    | 25,000.00      | 134,750.00    | 0.35  |
| GARAN                                    | 75,000.00      | 668,250.00    | 1.72  |
| ICBCT                                    | 75,000.00      | 375,750.00    | 0.96  |
| ISGYO                                    | 0.58           | 0.58          | 0.00  |
| KAREL                                    | 375,000.00     | 2,276,250.00  | 5.84  |
| KRDMD                                    | 125,000.18     | 595,000.83    | 1.53  |
| MAVI                                     | 27,500.00      | 1,339,800.00  | 3.44  |
| ODAS                                     | 225,000.00     | 983,250.00    | 2.52  |
| PEKGY                                    | 75,000.00      | 427,500.00    | 1.10  |
| SODA                                     | 0.86           | 4.59          | 0.00  |
| THYAO                                    | 75,000.00      | 1,248,750.00  | 3.21  |
| YKBNK                                    | 175,000.00     | 703,500.00    | 1.81  |
| TOPLAM                                   | 1,377,501.62   | 11,702,806.00 | 30.04 |
| B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI     |                |               |       |
| TRT080720T19                             | 63,000.00      | 57,730.68     | 0.15  |
| TRT110827T16                             | 69,000.00      | 59,317.23     | 0.15  |
| TRT120325T12                             | 27,000.00      | 20,328.03     | 0.05  |
| TRT150120T16                             | 3,000.00       | 2,885.58      | 0.01  |
| TRT240724T15                             | 14,000.00      | 11,628.12     | 0.03  |
| TRT270923T11                             | 2,000.00       | 1,621.78      | 0.00  |
| TOPLAM                                   | 178,000.00     | 153,511.42    | 0.39  |
| VALÖRLÜ İŞLEMLER                         |                |               |       |
| C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ             |                |               |       |
| D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.) |                |               |       |

|                                     |   |              |               |       |
|-------------------------------------|---|--------------|---------------|-------|
| E) DÖVİZE ENDEKSİ TAHVİLLER         | : |              |               |       |
| F) FİNANSMAN BONOLARI               | : |              |               |       |
| TRFDFKT91817                        |   | 500,000.00   | 479,630.00    | 1.23  |
| TRFGRAN91819                        |   | 500,000.00   | 482,015.00    | 1.24  |
| TRFNURL91817                        |   | 1,000,000.00 | 962,720.00    | 2.47  |
| TRFYAKF91813                        |   | 1,000,000.00 | 961,370.00    | 2.47  |
| TOPLAM                              |   | 3,000,000.00 | 2,885,735.00  | 7.41  |
| VALÖRLÜ İŞLEMLER                    | : |              |               |       |
| G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ           | : |              |               |       |
| TRSAKYP41612                        |   | 342,500.00   | 360,107.93    | 0.92  |
| TRSCCLKM31910                       |   | 1,500,000.00 | 1,553,595.00  | 3.99  |
| TRSDGOZ71918                        |   | 160,000.00   | 160,000.00    | 0.41  |
| TRSDOGH31910                        |   | 630,000.00   | 652,018.50    | 1.67  |
| TRSENSA72211                        |   | 1,000,000.00 | 1,108,440.00  | 2.85  |
| TRSFNF91815                         |   | 1,000,000.00 | 1,030,400.00  | 2.65  |
| TRSKRSNE2018                        |   | 500,000.00   | 513,240.00    | 1.32  |
| TRSOPAS22111                        |   | 700,000.00   | 708,078.00    | 1.82  |
| TRSORFN31910                        |   | 1,000,000.00 | 893,330.00    | 2.29  |
| TRSSRTNE1912                        |   | 500,000.00   | 512,070.00    | 1.31  |
| TRSTBTF31928                        |   | 300,000.00   | 267,372.00    | 0.69  |
| TRSYDAT71814                        |   | 500,000.00   | 508,770.00    | 1.31  |
| XS1629734879                        |   | 650,000.00   | 633,298.25    | 1.63  |
| TOPLAM                              |   | 8,782,500.00 | 8,900,719.68  | 22.85 |
| VALÖRLÜ İŞLEMLER                    | : |              |               |       |
| H) KİRA SERTİFİKALARI               | : |              |               |       |
| VALÖRLÜ İŞLEMLER                    | : |              |               |       |
| I) YABANCI MENKUL KIYMETLER         | : |              |               |       |
| XS0982644774                        |   | 500000.00    | 2252991.05    | 5.78  |
| TOPLAM                              |   | 500,000.00   | 2,252,991.05  | 5.78  |
| İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER | : |              |               |       |
| J) REPO                             | : |              |               |       |
| K) TERS REPO                        | : |              |               |       |
| L) DİĞER                            | : |              |               |       |
| Forward EURO/TL                     |   | -250,000.00  |               |       |
| Forward USD/TL                      |   | -500,000.00  |               |       |
| YPK                                 |   | 1,182,948.00 | 1,529,457.13  | 3.93  |
| Vadeli Mevduat YP gün 46            |   | 250,000.00   | 1,313,116.99  | 3.37  |
| Vadeli Mevduat gün 49               |   | 1,000,000.00 | 1,011,790.48  | 2.60  |
| Vadeli Mevduat gün 49               |   | 1,000,000.00 | 1,011,672.25  | 2.60  |
| Vadeli Mevduat gün 49               |   | 1,000,000.00 | 1,011,869.29  | 2.60  |
| F_XU0300618                         |   | -250.00      | -3,110,625.00 |       |
| BPP                                 |   | 4,511,013.61 | 4,511,013.61  | 11.58 |
| BPP                                 |   | 21,009.81    | 21,009.81     | 0.05  |
| TOPLAM                              |   |              | 10,409,929.56 | 26.72 |
| M) VARANT                           | : |              |               |       |
| N) VIOP NAKİT TEMİNAT               | : |              |               |       |
|                                     |   | 1,682,826.19 | 1,682,826.19  | 4.32  |
| TOPLAM                              |   | 1,682,826.19 | 1,682,826.19  | 4.32  |
| O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER          | : |              |               |       |

|                  |   |              |            |      |
|------------------|---|--------------|------------|------|
| VALÖRLÜ İŞLEMLER | : |              |            |      |
| O) VDMK          | : |              |            |      |
| TRPAK5F81818     |   | 1,000,000.00 | 967,630.00 | 2.48 |
| TOPLAM           |   | 1,000,000.00 | 967,630.00 | 2.48 |
| VALÖRLÜ İŞLEMLER | : |              |            |      |

#### 4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

|                               |   |               |
|-------------------------------|---|---------------|
| A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU | : | 38,956,148.89 |
| B. HAZIR DEĞERLER (+)         | : | 9,287.33      |
| C. ALACAKLAR (+)              | : | 2,473,000.22  |
| D. DİĞER VARLIKLAR (+)        | : | 0.00          |
| E. BORÇLAR (-)                | : | 267,248.35    |
| FON TOPLAM DEĞERİ             | : | 40,651,080.16 |

#### 5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

| Açıklama                                    | Tutarı     |
|---------------------------------------------|------------|
| 37001 Fon Yönetim Ücreti                    | 54,230.58  |
| 37002 Denetim Ücreti                        | 426.00     |
| 370031 SGMK Tahvil Borsa Payı               | 256.14     |
| 370034 Yabancı Menkul Komisyonu             | 1,331.49   |
| 37004 Aracılık Komisyonu                    | 14,318.42  |
| 37005 Vergi, Resim ve Harçlar               | 808.91     |
| 37006 Saklama Giderleri                     | 1,620.47   |
| 37008 Banka Masrafları                      | 233.94     |
| 37010 Kap Gideri                            | 238.50     |
| 37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu | 4,464.47   |
| 37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti          | 735.40     |
| 37023 VIOP İşlemi Komisyonu                 | 52,679.87  |
| 37028 Portföy Saklama Hizmeti               | 1,862.00   |
| 37030 E-fatura Gideri                       | 164.10     |
| 37099 Diğer Giderler                        | 237.60     |
| Toplam                                      | 133,607.89 |

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

| Açıklama          | Giriş Tarihi | Stok     | Kazanılan Nominal |
|-------------------|--------------|----------|-------------------|
| ISGYO Bds :%4.92  | 04.05.2018   | 0.55     | 0.03              |
| DGATE Tem :%40.00 | 29.05.2018   | 25000.00 | 10000.00          |
| MAVI Tem :%52.20  | 29.05.2018   | 25000.00 | 13051.13          |
| SODA Tem :%25.00  | 30.05.2018   | 0.86     | 0.22              |

#### 7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR

#### 8- İTFALAR

| Menkul Kıymet Türü | İtfa Tarihi | Nominal    |
|--------------------|-------------|------------|
| TRSTBTF51819       | 04.05.2018  | 1500000.00 |

TRFVDTF51818

15.05.2018

1000000.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR

: