

YKP
(YOT) YAPI KREDİ PORTFOY ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
HAZİRAN 2018 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	(YOT) YAPI KREDİ PORTFOY ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	9,487,209.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	124,151,903.31
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	22,996,397.21
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	29.08.1996
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	5.398755
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	5.387899
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	0.20%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	3.13%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	7.57%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		33.22%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		48.06%
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		11.43%
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	7.30%
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	0.05%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	77.83%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	301.138
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	44,875,367.30
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	13,010,917.21

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT020322T17	1,200,000.00	1,047,756.00	0.86
TRT080720T19	27,000.00	24,403.95	0.02
TRT100719T18	25,000.00	23,840.00	0.02
TRT110226T13	1,000,000.00	804,030.00	0.66
TRT110718T18	15,000,000.00	15,582,300.00	12.76
TRT131119T19	2,000,000.00	1,908,540.00	1.56
TRT150120T16	10,500,000.00	9,983,925.00	8.18
TRT160119T18	1,338,000.00	1,222,263.00	1.00
TRT170221T12	1,900,000.00	1,694,762.00	1.39
TRT180123T10	2,000,000.00	1,827,980.00	1.50
TRT200219T11	2,500,000.00	3,796,675.00	3.11
TRT220921T18	5,500,000.00	4,557,850.00	3.73
TRT240724T15	5,000,000.00	3,877,400.00	3.18
TOPLAM	47,990,000.00	46,351,724.95	37.96
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
TRT240724T15	-3,000,000.00	-2,300,520.00	-1.88
TOPLAM	-3,000,000.00	-2,300,520.00	-1.88
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFALFK91810	2,700,000.00	2,611,710.00	2.14
TRFDFKT91817	1,000,000.00	972,090.00	0.80
TRFFNBK91830	3,000,000.00	2,891,850.00	2.37

TRFISFN91838	3,450,000.00	3,335,874.00	2.73
TRFKFTF21918	1,440,000.00	1,301,918.40	1.07
TRFNURL71819	750,000.00	745,320.00	0.61
TRFNURL91817	1,200,000.00	1,169,376.00	0.96
TRFOYMDE1812	600,000.00	575,316.00	0.47
TRFVFAS71822	2,200,000.00	2,185,304.00	1.79
TRFYKFKE1824	1,500,000.00	1,436,205.00	1.18
TRFYKYM81828	5,500,000.00	5,358,375.00	4.39
TOPLAM	23,340,000.00	22,583,338.40	18.50
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSAKFK81816	1,600,000.00	1,697,392.00	1.39
TRSAKFKK1910	1,500,000.00	1,835,235.00	1.50
TRSALJFK1813	1,000,000.00	1,021,120.00	0.84
TRSCCLKM31910	2,100,000.00	2,205,399.00	1.81
TRSDOGH31910	1,130,000.00	1,146,746.60	0.94
TRSENSA72211	1,750,000.00	1,972,915.00	1.62
TRSGFYH31914	2,270,000.00	2,278,989.20	1.87
TRSICICE1818	888,000.00	924,345.84	0.76
TRSISFN91815	2,000,000.00	2,015,200.00	1.65
TRSIGYE1915	750,000.00	777,120.00	0.64
TRSKCTF32014	1,000,000.00	1,040,650.00	0.85
TRSKCTF41916	500,000.00	450,935.00	0.37
TRSKCTFA1812	1,000,000.00	1,009,270.00	0.83
TRSKCTY32015	100,000.00	101,431.00	0.08
TRSKCTYE1815	890,000.00	903,892.90	0.74
TRSKFTF42016	1,300,000.00	1,332,487.00	1.09
TRSKFTFA1819	1,000,000.00	938,440.00	0.77
TRSKRSNE2018	1,000,000.00	1,036,830.00	0.85
TRSNLOG21912	1,100,000.00	1,128,006.00	0.92
TRSOPAS22111	1,500,000.00	1,539,870.00	1.26
TRSORFN72013	1,500,000.00	1,552,065.00	1.27
TRSOTKOK1815	145,000.00	145,913.50	0.12
TRSRNSHE1916	1,000,000.00	1,038,880.00	0.85
TRSSRTNA1817	1,100,000.00	1,116,093.00	0.91
TRSTATKK1816	130,000.00	131,491.10	0.11
TRSTBTF31910	800,000.00	727,200.00	0.60
TRSTBTF31928	510,000.00	460,162.80	0.38
TRSTHALE2716	500,000.00	507,800.00	0.42
TRSTIMG41917	550,000.00	574,832.50	0.47
TRSTISB72712	100,000.00	103,105.00	0.08
TRSVKFB92719	2,000,000.00	2,014,420.00	1.65
TRSYDAT71814	1,000,000.00	1,025,270.00	0.84
TRSZFKL21916	1,760,000.00	1,810,476.80	1.48
XS1629734879	2,350,000.00	2,124,623.25	1.74
TOPLAM	37,823,000.00	38,688,607.49	31.69
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		

I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
L) DİĞER	:			
Vadeli Mevduat gün 34		2,000,000.00	2,011,592.62	1.65
Vadeli Mevduat gün 34		2,100,000.00	2,112,266.04	1.73
Vadeli Mevduat gün 46		2,000,000.00	2,011,615.51	1.65
Vadeli Mevduat gün 46		2,100,000.00	2,112,351.60	1.73
BPP		5,396,635.56	5,396,635.56	4.42
BPP		3,224,383.57	3,128,665.91	2.56
TOPLAM			16,773,127.24	13.74
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	:	122,096,278.08		
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	3,511.19		
C. ALACAKLAR (+)	:	2,293,770.25		
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00		
E. BORÇLAR (-)	:	241,656.21		
FON TOPLAM DEĞERİ	:	124,151,903.31		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	:			
Açıklama			Tutarı	
37001 Fon Yönetim Ücreti		221,635.06		
37002 Denetim Ücreti		114.70		
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı		758.05		
37005 Vergi, Resim ve Harçlar		3,044.29		
37006 Saklama Giderleri		3,070.93		
37008 Banka Masrafları		474.18		
37010 Kap Gideri		239.94		
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu		2,570.01		
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti		930.98		
37028 Portföy Saklama Hizmeti		2,332.75		
37030 E-fatura Gideri		169.57		
37098 Küsürat farkları		0.01		
37099 Diğer Giderler		245.52		
Toplam		235,585.99		
6- GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI, BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM, TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR	:			

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

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR	:		
------------------------	---	--	--

8- İTFALAR	:		
------------	---	--	--

Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal
TRFYKYM61812	01.06.2018	5500000.00
TRFYKFK61815	05.06.2018	1500000.00
TRSDEVA61813	07.06.2018	100000.00
TRFISFN61815	08.06.2018	4000000.00
TRFFINF61812	13.06.2018	3000000.00
TRSKALE61819	21.06.2018	200000.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR	:		
---------------------	---	--	--