

YKP
(YOT) YAPI KREDİ PORTFOY ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
OCAK 2019 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	:	140,326,339.35
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	22,956,299.01
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	29.08.1996
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	6.112760
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	5.957509
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	2.61%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	2.61%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	15.46%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		57.54%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		27.18%
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		6.64%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		1.08%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.00%
Yabancı Hisse Senetleri		0.00%
VIOP Nakit Teminat		2.12%

Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	1.61%
Vadeli_YP	1.99%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	0.00%
Katılma Belgesi YP	0.00%
CC Swap	0.00%
FX Swap	0.00%
IR Swap	0.00%
VDMK	1.84%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 0.05%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	55.79%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 449.147
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 2,795,785.25
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	: 1,782,703.41

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT020322T17	1,200,000.00	1,117,344.00	0.84
TRT050220T17	10,400,000.00	9,765,704.00	7.31
TRT080323T10	90,000.00	71,352.90	0.05
TRT080328T15	100,000.00	97,299.00	0.07
TRT080720T19	64,000.00	57,990.40	0.04
TRT100719T18	31,000.00	29,662.66	0.02
TRT110226T13	6,000,000.00	5,281,980.00	3.95
TRT120122T17	61,000.00	52,110.47	0.04
TRT120325T12	13,000.00	10,157.42	0.01
TRT120820T12	11,000,000.00	12,983,630.00	9.71
TRT131119T19	2,800,000.00	2,747,808.00	2.06
TRT140623T19	8,800,000.00	9,342,168.00	6.99
TRT140922T17	92,000.00	78,349.96	0.06
TRT150120T16	19,300,000.00	18,157,054.00	13.58
TRT150519T15	7,800,000.00	7,787,754.00	5.83
TRT170221T12	1,900,000.00	1,787,026.00	1.34
TRT180123T10	2,000,000.00	1,819,100.00	1.36
TRT200219T11	7,500,000.00	13,013,550.00	9.74
TRT200324T13	515,000.00	456,614.45	0.34
TRT240227T17	200,000.00	178,726.00	0.13
TRT240724T15	222,000.00	174,793.92	0.13
TRT270923T11	141,000.00	116,654.94	0.09

TOPLAM	80,229,000.00	85,126,830.12	63.68
VALÖRLÜ İŞLEMLER :			
TRT050220T17	5,000,000.00	4,680,850.00	3.50
TRT110226T13	-3,000,000.00	-2,697,330.00	-2.02
TRT120820T12	-4,000,000.00	-4,708,680.00	-3.52
TRT140623T19	-4,000,000.00	-4,240,400.00	-3.17
TRT220921T18	0.00	0.00	0.00
TOPLAM	-6,000,000.00	-6,965,560.00	-5.21
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ :			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.) :			
E) DÖVİZE ENDEKSİ TAHVİLLER :			
F) FİNANSMAN BONOLARI :			
TRFDFKT31912	1,000,000.00	1,037,290.00	0.78
TRFGRFA21911	2,000,000.00	2,000,000.00	1.50
TRFKFTF21918	1,440,000.00	1,440,000.00	1.08
TOPLAM	4,440,000.00	4,477,290.00	3.35
VALÖRLÜ İŞLEMLER :			
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ :			
TRSAKFKK1910	2,500,000.00	3,343,875.00	2.50
TRSCCLKM31910	2,100,000.00	2,306,703.00	1.73
TRSDOGH31910	1,130,000.00	1,069,906.60	0.80
TRSENSA72211	2,750,000.00	3,416,215.00	2.56
TRSGFYH31914	2,270,000.00	2,310,610.30	1.73
TRSIGGYE1915	750,000.00	743,445.00	0.56
TRSKCTF32014	1,000,000.00	991,490.00	0.74
TRSKCTF41916	500,000.00	487,565.00	0.36
TRSKCTY32015	100,000.00	103,995.00	0.08
TRSKFTF42016	1,300,000.00	1,267,864.00	0.95
TRSKRSNE2018	1,000,000.00	989,420.00	0.74
TRSNLOG21912	1,100,000.00	1,158,179.00	0.87
TRSOPAS22111	1,500,000.00	1,540,830.00	1.15
TRSORFN72013	1,500,000.00	1,489,695.00	1.11
TRSRNSHE1916	1,000,000.00	1,014,220.00	0.76
TRSTBTF31910	800,000.00	782,744.00	0.59
TRSTBTF31928	510,000.00	495,648.60	0.37
TRSTHALE2716	800,000.00	809,920.00	0.61
TRSTIMG41917	550,000.00	556,198.50	0.42
TRSTISB72712	100,000.00	105,275.00	0.08
TRSVKFB92719	2,000,000.00	2,019,900.00	1.51
TRSZFKL21916	1,760,000.00	1,839,164.80	1.38
XS1629734879	3,350,000.00	3,044,329.25	2.28
TOPLAM	30,370,000.00	31,887,193.05	23.85
VALÖRLÜ İŞLEMLER :			
H) KİRA SERTİFİKALARI :			
VALÖRLÜ İŞLEMLER :			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER :			
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER :			
J) REPO :			
K) TERS REPO :			

TRT120619T17		7,760,805.00	7,004,506.85	5.24
TOPLAM		7,760,805.00	7,004,506.85	5.24
L) DİĞER	:			
Forward EURO/TL		-450,000.00		
Vadeli Mevduat YP gün 50		450,000.00	2,705,300.23	2.02
Vadeli Mevduat gün 50		2,200,000.00	2,260,771.25	1.69
F_USDTRY0219		-500.00	-2,624,700.00	
F_XAUTRYM0219		10,000.00	2,239,700.00	
BPP		607,389.98	607,389.98	0.45
TOPLAM			5,573,461.46	4.17
M) VARANT	:			
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:			
		3,987,056.58	3,987,056.58	2.98
TOPLAM		3,987,056.58	3,987,056.58	2.98
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
O) VDMK	:			
TRPKYVFA2318		2,500,000.00	2,580,975.00	1.93
TOPLAM		2,500,000.00	2,580,975.00	1.93
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU	:			
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	133,671,753.06		
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	5,517.19		
C. ALACAKLAR (+)	:	16,147,929.41		
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00		
E. BORÇLAR (-)	:	9,498,860.31		
FON TOPLAM DEĞERİ	:	140,326,339.35		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	:			
Açıklama		Tutarı		
37001 Fon Yönetim Ücreti		352,170.81		
37002 Denetim Ücreti		268.80		
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı		424.86		
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı		2,238.60		
37005 Vergi, Resim ve Harçlar		367.50		
37006 Saklama Giderleri		2,264.75		
37008 Banka Masrafları		584.68		
37009 Noter Tasdik ve Ücreti		86.69		
37010 Kap Gideri		140.84		
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu		1,150.91		
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti		2,382.18		
37023 VIOP İşlemi Komisyonu		3,057.80		
37028 Portföy Saklama Hizmeti		2,969.75		
37099 Diğer Giderler		367.50		
Toplam		368,475.67		
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	İtfa Tarihi	Nominal
TRFFFKR11921	08.01.2019	1500000.00
TRFYKFK11919	11.01.2019	1050000.00
TRFVKFK11915	15.01.2019	510000.00
TRT160119T18	16.01.2019	1338000.00
TRFVFAS11919	18.01.2019	1000000.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR :

10- ÖDÜNÇ İŞLEMLER :

A) ÖDÜNÇ VERİLEN :

Sermaye Piyasası Aracı	Menkul Kıymet	Nominal	Vade Tarihi	Cari Piyasa Değeri
------------------------	---------------	---------	-------------	--------------------

B) ÖDÜNÇ ALINAN :

Sermaye Piyasası Aracı	Menkul Kıymet	Nominal	Vade Tarihi	Cari Piyasa Değeri
------------------------	---------------	---------	-------------	--------------------