

YKP
(YBS) YAPI KREDİ PORTFOY ÖZEL SEKTÖR BORCLANMA ARAÇLARI FONU
OCAK 2019 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	(YBS) YAPI KREDİ PORTFOY ÖZEL SEKTÖR BORCLANMA ARAÇLARI FONU
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFOY YONETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	600,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	316,603,663.95
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	15,779,971,791.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	25.01.2012
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.020064
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.019752
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.58%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	1.58%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	17.06%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		0.00%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		82.34%
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		9.43%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		1.34%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.00%
Yabancı Hisse Senetleri		0.00%
VIOP Nakit Teminat		0.50%

Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	1.85%
Vadeli_YP	1.86%
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	2.68%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	16.34%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	19.31%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	135.729
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	53,051,346.20
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	18,130,230.69

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFAKFK41916	4,000,000.00	3,855,120.00	1.20
TRFAKYM31914	7,000,000.00	6,763,540.00	2.10
TRFAKYM31922	3,500,000.00	3,383,520.00	1.05
TRFBOLU71910	1,650,000.00	1,491,220.50	0.46
TRFDGOZ71915	1,976,400.00	1,976,400.00	0.61
TRFFFKR21912	10,000.00	9,975.40	0.00
TRFFFKR21920	10,000.00	9,932.50	0.00
TRFFFKR41936	2,800,000.00	2,685,704.00	0.83
TRFFINF21915	10,000.00	9,890.00	0.00
TRFGRAN21915	5,000,000.00	4,978,000.00	1.54
TRFGRFA21911	4,000,000.00	4,000,000.00	1.24
TRFGRFA41919	6,800,000.00	6,459,456.00	2.00
TRFGRFA41927	2,000,000.00	1,909,620.00	0.59
TRFGRFA51918	10,000.00	9,493.10	0.00
TRHFHAS21917	10,000.00	9,890.80	0.00
TRFHLFK31910	5,000,000.00	4,901,350.00	1.52
TRFHLFK51918	4,000,000.00	3,768,760.00	1.17

TRFISFA21923	5,000,000.00	4,946,600.00	1.53
TRFISFA41921	1,250,000.00	1,190,800.00	0.37
TRFISFN31933	13,660,000.00	13,175,070.00	4.09
TRFISFN41916	5,010,000.00	4,807,395.60	1.49
TRFISFN41957	4,000,000.00	3,823,000.00	1.19
TRFISFN51923	4,000,000.00	3,738,800.00	1.16
TRFISMD21923	5,000,000.00	4,987,750.00	1.55
TRFOTKO41910	2,520,000.00	2,390,472.00	0.74
TRFSUZK51914	1,500,000.00	1,382,100.00	0.43
TRFTBTF51915	2,000,000.00	1,862,560.00	0.58
TRFVFAS51915	4,080,000.00	3,842,707.20	1.19
TRFYKYM31914	4,000,000.00	3,888,000.00	1.21
TOPLAM	99,796,400.00	96,257,127.10	29.86
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSAKFKK1910	200,000.00	267,510.00	0.08
TRSAKYP41612	3,253,744.00	3,421,018.98	1.06
TR SAYGZ12024	5,000,000.00	4,408,950.00	1.37
TRSAZEV21919	1,800,000.00	1,894,356.00	0.59
TRSCLKM31910	3,850,000.00	4,228,955.50	1.31
TRSDOGH31910	3,800,000.00	3,597,916.00	1.12
TRSENSA72211	5,000,000.00	6,211,300.00	1.93
TRSGFYH31914	5,450,000.00	5,547,500.50	1.72
TRSIGY31915	2,500,000.00	2,534,850.00	0.79
TRSIGY32111	3,640,000.00	3,692,743.60	1.15
TRSIGY61912	3,000,000.00	3,037,650.00	0.94
TRSIGYE1915	2,760,000.00	2,735,877.60	0.85
TRSKALE62114	5,000,000.00	5,120,950.00	1.59
TRSKCTF31917	2,000,000.00	2,074,200.00	0.64
TRSKCTF32014	2,000,000.00	1,982,980.00	0.62
TRSKCTY32015	3,410,000.00	3,546,229.50	1.10
TRSKCTY62012	4,000,000.00	4,071,800.00	1.26
TRSKFTF42016	4,800,000.00	4,681,344.00	1.45
TRSKFTF61917	3,000,000.00	2,967,960.00	0.92
TRSKFTF61925	2,600,000.00	2,644,382.00	0.82
TRSKRSNE1911	5,700,000.00	5,648,757.00	1.75
TRSKRSNE2018	200,000.00	197,884.00	0.06
TRSNLOG21912	3,000,000.00	3,158,670.00	0.98
TRSOPAS22111	11,000,000.00	11,299,420.00	3.51
TRSOPAS42010	7,000,000.00	7,297,640.00	2.26
TRSORFN72013	3,490,000.00	3,466,023.70	1.08
TRSOTKO12013	5,000,000.00	5,546,000.00	1.72
TRSRNSH22023	5,000,000.00	5,242,450.00	1.63
TRSRNSHE1916	500,000.00	507,110.00	0.16
TRSSRTNE1912	3,000,000.00	3,029,010.00	0.94
TRSTBTF31910	1,300,000.00	1,271,959.00	0.39
TRSTHALE2716	3,200,000.00	3,239,680.00	1.01
TRSTIMG41917	2,200,000.00	2,224,794.00	0.69
TRSTIMGE1918	2,000,000.00	1,953,460.00	0.61

TRSTISB72712		11,000,000.00	11,580,250.00	3.59
TRSTPRS12115		1,000,000.00	1,004,820.00	0.31
TRSTTRK42012		2,740,000.00	2,958,542.40	0.92
TRSVKFB92719		3,000,000.00	3,029,850.00	0.94
TRSYDAT22015		10,000,000.00	10,098,100.00	3.13
TRSZFKL21916		9,480,000.00	9,906,410.40	3.07
TOPLAM		156,873,744.00	161,329,304.18	50.05
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
H) KİRA SERTİFİKALARI	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
TRT080323T10		42,228,055.00	31,520,280.82	9.78
TOPLAM		42,228,055.00	31,520,280.82	9.78
L) DİĞER	:			
Forward EURO/TL		-1,000,000.00		
Vadeli Mevduat YP gün 50		1,000,000.00	6,011,778.29	1.87
Vadeli Mevduat gün 50		6,000,000.00	6,165,739.77	1.91
BPP		5,042,739.73	5,023,307.85	1.56
BPP		5,019,643.84	5,006,485.90	1.55
BPP		379,243.49	379,243.49	0.12
TOPLAM			22,586,555.30	7.01
M) VARANT	:			
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:			
		1,678,744.76	1,678,744.76	0.52
TOPLAM		1,678,744.76	1,678,744.76	0.52
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
O) VDMK	:			
TRPAK3T21919		1,750,000.00	1,740,305.00	0.54
TRPKYVFA2318		7,000,000.00	7,226,730.00	2.24
TOPLAM		8,750,000.00	8,967,035.00	2.78
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU	:			
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	322,339,047.16		
B. HAZİR DEĞERLER (+)	:	4,267.76		
C. ALACAKLAR (+)	:	199,489.00		
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00		
E. BORÇLAR (-)	:	541,721.00		
FON TOPLAM DEĞERİ	:	316,603,663.95		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	:			
Açıklama			Tutarı	
37001 Fon Yönetim Ücreti		503,830.32		
37002 Denetim Ücreti		253.00		

370031	SGMK Tahvil Borsa Payı	210.67
370032	O/N RRP Tahvil Borsa Payı	7,803.60
37005	Vergi, Resim ve Harçlar	1,012.20
37006	Saklama Giderleri	8,310.38
37008	Banka Masrafları	1,337.73
37009	Noter Tasdik ve Ücreti	86.69
37015	Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	2,643.54
37021	Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	5,602.72
37028	Portföy Saklama Hizmeti	3,165.51
37099	Diğer Giderler	126.72
	Toplam	534,383.08

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

Açıklama : Giriş Tarihi Stok Kazanılan Nominal

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR :

8- İTFALAR :

Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal
TRFISFA11916	07.01.2019	1780000.00
TRFCLKM11919	08.01.2019	3600000.00
TRFFFKR11921	08.01.2019	1300000.00
TRFHLEK11912	09.01.2019	4000000.00
TRFBOLU11916	14.01.2019	3225000.00
TRFAKFK11919	15.01.2019	4800000.00
TRFVKFK11915	15.01.2019	1020000.00
TRSKCTF11919	16.01.2019	1820000.00
TRFFNBK11945	18.01.2019	5000000.00
TRFVFAS11919	18.01.2019	8000000.00
TRFISFA11924	22.01.2019	3870000.00
TRFGRFA11920	23.01.2019	2230000.00
TRFTEBK11911	24.01.2019	10000.00
TRSRNSH11919	24.01.2019	5000000.00
TRFFNBK11952	25.01.2019	5000000.00
TRFGRFK11911	25.01.2019	6700000.00
TRFISFN11927	25.01.2019	4120000.00
TRFTHAL11922	25.01.2019	10000.00

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