

YKP**(YBE) YAPI KREDİ PORTFOY EUROBOND (DOLAR) BORCLANMA ARAÇLARI FONU****EYLÜL 2019 AYLIK RAPORUDUR.****1- FONU TANITICI BİLGİLER**

A. FONUN ADI	:	(YBE) YAPI KREDİ PORTFOY EUROBOND (DOLAR) BORCLANMA ARAÇLARI FONU
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	1,000,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	1,517,955,754.56
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	9,611,563,473.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	29.06.2000
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.157930
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.156013
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.23%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	16.14%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	11.69%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		7.21%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		2.75%
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%
Eurobond Repo		0.00%
Devlet Tahvili Ters Repo		2.85%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Eurobond Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		0.03%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		86.22%

Yabancı Hisse Senetleri	0.00%
VIOP Nakit Teminat	0.86%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	0.00%
Vadeli_YP	0.18%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	0.00%
Katılma Belgesi YP	0.00%
CC Swap	0.00%
FX Swap	-0.01%
IR Swap	-0.16%
VDMK	0.07%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	19.11%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	5.33%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	2153.955
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	38,383,893.66
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	17,472,998.02

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 ENDEKSİLİ TAHVİLLER			
TRT150121F11	17,020,000.00	107,094,812.05	7.02
TOPLAM	17,020,000.00	107,094,812.05	7.02
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFDGOZ71915	1,479,244.00	1,479,244.00	0.10
TOPLAM	1,479,244.00	1,479,244.00	0.10
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ			
TRSAYGZ12024	3,500,000.00	3,527,615.00	0.23
TRSKCTF32014	5,000,000.00	4,993,100.00	0.33
TRSKFTF42016	4,800,000.00	5,097,264.00	0.33
TRSKRSNE2018	400,000.00	415,540.00	0.03
TRSOPAS22012	2,000,000.00	2,019,720.00	0.13
TRSOPAS42010	8,000,000.00	8,265,280.00	0.54
TRSOTKO12013	3,050,000.00	3,156,018.00	0.21
TRSOTKO22012	5,000,000.00	5,022,350.00	0.33
TRSRNSH22023	2,000,000.00	2,040,820.00	0.13

TRSTIMGE1918	1,000,000.00	1,055,280.00	0.07
TRSYKKBK62914	4,500,000.00	4,785,030.00	0.31
TOPLAM	39,250,000.00	40,378,017.00	2.65
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
US900123AL40	2230000.00	17599746.39	1.15
US900123AT75	12810000.00	80782600.61	5.30
US900123AW05	7340000.00	44449593.83	2.92
US900123AY60	15750000.00	89063384.90	5.84
US900123BB58	11051000.00	64800277.63	4.25
US900123BG46	11250000.00	63554481.71	4.17
US900123BJ84	15485000.00	79654508.37	5.22
US900123CF53	22200000.00	125270720.03	8.22
US900123CG37	16500000.00	90201705.08	5.92
US900123CK49	500000.00	2681688.71	0.18
US900123CL22	10000000.00	55637852.08	3.65
US900123CM05	6197000.00	31358046.12	2.06
US900123CQ19	13000000.00	73790700.26	4.84
US900123CR91	4000000.00	24338794.87	1.60
US900123CT57	9200000.00	58095570.56	3.81
XS0847042024	6553000.00	36428603.52	2.39
XS0849728190	1600000.00	8890633.48	0.58
XS1003016018	115000.00	669508.74	0.04
XS1175854923	6050000.00	33310237.67	2.18
XS1376681067	163000.00	904275.21	0.06
XS1390320981	11400000.00	65489833.42	4.30
XS1571399754	10000000.00	56589662.09	3.71
XS1578203462	6770000.00	37655554.54	2.47
XS1584113184	141000.00	718469.37	0.05
XS1684378208	11834000.00	63661888.66	4.18
XS1711581337	1400000.00	7592085.84	0.50
XS1750996206	9690000.00	53155930.88	3.49
XS1788516679	5200000.00	28900721.74	1.90
XS1917720911	300000.00	1818493.26	0.12
XS1958649854	2000000.00	12242765.54	0.80
XS1961766596	4100000.00	23783942.97	1.56
XS1970705528	1000000.00	5755896.76	0.38
TOPLAM	235,829,000.00	1,338,848,174.84	87.81
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TRT140623T19	10,579,100.00	11,505,088.36	0.75
TRT180924T11	5,607,125.00	8,503,760.96	0.56
TRT270923T11	572,355.00	500,223.97	0.03
TOPLAM	16,758,580.00	20,509,073.29	1.35
L) DİĞER	:		
Forward EURO/USD	-7,000,000.00		

FX Swap YBE-0309/0411	10,000,000.00	352,553.80	0.02
IR Swap SLZE06W1	10,000,000.00	-2,138,267.89	-0.14
YPL	325,000.00	1,988,963.34	0.13
F_USDTRY1019	-23,500.00	-134,182,650.00	
TOPLAM		203,249.25	0.01
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		
	15,105,145.07	15,105,145.07	0.99
TOPLAM	15,105,145.07	15,105,145.07	0.99
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
O) VDMK	:		
TRPTYV232410	1,000,000.00	1,046,620.00	0.07
TOPLAM	1,000,000.00	1,046,620.00	0.07
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	1,524,664,335.49
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	5,377.51
C. ALACAKLAR (+)	:	586,675.16
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	5,821,389.60
FON TOPLAM DEĞERİ	:	1,517,955,754.56

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	3,562,661.09
37002 Denetim Ücreti	754.00
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	9,633.57
370034 Yabancı Menkul Komisyonu	1,287.47
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	93,017.24
37006 Saklama Giderleri	14,761.51
37008 Banka Masrafları	108.24
37010 Kap Gideri	247.37
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	270.38
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	25,734.79
37023 VIOP İşlemi Komisyonu	21,403.99
37028 Portföy Saklama Hizmeti	3,958.50
37030 E-fatura Gideri	118.00
37098 Küsürat farkları	3.92
37099 Diğer Giderler	137.46
Toplam	3,734,097.53

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

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