

YKP
(YBS) YAPI KREDİ PORTFOY ÖZEL SEKTÖR BORCLANMA ARAÇLARI FONU
EYLÜL 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	:	507,625,235.94
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	22,129,008,176.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	25.01.2012
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.022939
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.022616
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.43%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	16.14%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	22.77%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		1.57%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		86.13%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		0.95%
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		9.24%
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		0.56%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.00%

Yabancı Hisse Senetleri	0.00%
VIOP Nakit Teminat	0.41%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	0.00%
Vadeli_YP	0.00%
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	1.14%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	20.19%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	46.78%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	91.667
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	98,293,704.53
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	13,174,110.21

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT160920T25	21,000,000.00	18,558,120.00	3.61
TOPLAM	21,000,000.00	18,558,120.00	3.61
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSİLİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFAKBKE1966	20,000,000.00	19,882,000.00	3.87
TRFDFKT22010	3,000,000.00	2,787,630.00	0.54
TRFDGOZ71915	1,584,904.00	1,584,904.00	0.31
TRFDZBK32023	10,000,000.00	10,097,000.00	1.97
TRFDZBKE1925	3,000,000.00	2,995,740.00	0.58
TRFDZBKE1958	15,000,000.00	14,853,600.00	2.89
TRFDZBKK1927	10,000,000.00	9,791,300.00	1.91
TRFFFKRE1929	10,000,000.00	9,863,900.00	1.92
TRFFNBKA1954	10,000,000.00	9,688,100.00	1.89
TRFFNBKE1935	2,500,000.00	2,481,525.00	0.48
TRFFNYME1928	5,000,000.00	4,930,650.00	0.96
TRFGRANA1916	15,000,000.00	15,150,450.00	2.95
TRFGRFKA1914	6,700,000.00	6,552,064.00	1.28

TRFHLFKE1915	10,000,000.00	9,993,700.00	1.95
TRFISFNE1914	3,120,000.00	3,114,384.00	0.61
TRFISGYA1914	9,110,000.00	8,880,792.40	1.73
TRFISGYK1912	3,640,000.00	3,575,317.20	0.70
TRFISGYK1920	9,000,000.00	8,832,510.00	1.72
TRFISMDE1925	15,000,000.00	14,863,650.00	2.90
TRFTCZB32018	19,780,000.00	20,016,766.60	3.90
TRFTCZB32026	3,170,000.00	3,185,659.80	0.62
TRFTCZB82013	8,870,000.00	9,024,781.50	1.76
TRFTEBKK1932	15,000,000.00	14,814,750.00	2.89
TRFTHAL22010	7,000,000.00	7,102,620.00	1.38
TRFTHALK1913	7,000,000.00	7,157,220.00	1.39
TRFVFASE1912	4,860,000.00	4,856,986.80	0.95
TRFVFASK1914	5,230,000.00	5,132,303.60	1.00
TRFVKFBK1945	15,000,000.00	14,694,750.00	2.86
TRFYKBK32013	10,000,000.00	10,084,400.00	1.96
TRFYKYMK1938	5,000,000.00	4,902,750.00	0.96
TOPLAM	262,564,904.00	260,892,204.90	50.82
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSAKFKK1910	200,000.00	300,318.00	0.06
TRSAKYP41612	3,253,744.00	3,421,018.98	0.67
TR SARCL22117	5,000,000.00	5,110,500.00	1.00
TR SAYGZ12024	4,890,000.00	4,928,582.10	0.96
TR SAYGZ62110	2,100,000.00	2,116,317.00	0.41
TRSBOLU72119	2,500,000.00	2,640,550.00	0.51
TRSCMSA32112	3,190,000.00	3,215,201.00	0.63
TRSENSA72211	5,000,000.00	6,662,550.00	1.30
TRSERGL52117	3,500,000.00	3,597,335.00	0.70
TRSISGY32111	3,640,000.00	3,651,538.80	0.71
TRSISGYE1915	2,760,000.00	2,882,930.40	0.56
TRSKALE62114	5,000,000.00	4,961,550.00	0.97
TRSKCTF32014	2,000,000.00	1,997,240.00	0.39
TRSKCTY32015	3,410,000.00	3,458,319.70	0.67
TRSKCTY62012	4,000,000.00	4,159,480.00	0.81
TRSKFTF42016	4,800,000.00	5,097,264.00	0.99
TRSKFTF62113	4,000,000.00	4,036,040.00	0.79
TRSKRSNE1911	5,700,000.00	5,957,868.00	1.16
TRSKRSNE2018	200,000.00	207,770.00	0.04
TRSOPAS22111	10,900,000.00	11,106,119.00	2.16
TRSOPAS42010	7,000,000.00	7,232,120.00	1.41
TRSORFN72013	3,490,000.00	3,586,847.50	0.70
TRSOTKO12013	5,000,000.00	5,173,800.00	1.01
TRSOTKO32110	5,000,000.00	5,083,450.00	0.99
TRSRNSH22023	5,000,000.00	5,102,050.00	0.99
TRSRNSHE1916	500,000.00	523,950.00	0.10
TRSSRTN72114	2,500,000.00	2,645,650.00	0.52
TRSSRTNE1912	3,000,000.00	3,141,330.00	0.61
TRSTBTF32116	10,000,000.00	10,017,400.00	1.95

TRSTHALE2716		3,200,000.00	3,226,176.00	0.63
TRSTIMGE1918		2,000,000.00	2,110,560.00	0.41
TRSTISB72712		11,000,000.00	11,310,750.00	2.20
TRSTISB92918		8,000,000.00	8,018,640.00	1.56
TRSTPRS12115		1,000,000.00	1,039,980.00	0.20
TRSTTRK42012		2,740,000.00	2,940,979.00	0.57
TRSVKFB92719		3,000,000.00	2,996,190.00	0.58
TRSYDAT22015		10,000,000.00	10,105,000.00	1.97
TRSYKBK62914		4,500,000.00	4,785,030.00	0.93
XS1891679547		6,000,000.00	7,646,640.00	1.49
TOPLAM		168,973,744.00	176,195,034.48	34.32
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
H) KİRA SERTİFİKALARI	:			
TRD220921T16		3,000,000.00	4,439,910.00	0.86
TOPLAM		3,000,000.00	4,439,910.00	0.86
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
TRT010420T19		16,936,480.00	40,017,764.38	7.80
TRT120128T11		5,138,830.00	6,002,666.30	1.17
TOPLAM		22,075,310.00	46,020,430.68	8.96
L) DİĞER	:			
BPP		95,039.04	95,039.04	0.02
TOPLAM			95,039.04	0.02
M) VARANT	:			
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:			
		1,939,778.82	1,939,778.82	0.38
TOPLAM		1,939,778.82	1,939,778.82	0.38
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
O) VDMK	:			
TRPTYV232410		5,000,000.00	5,233,100.00	1.02
TOPLAM		5,000,000.00	5,233,100.00	1.02
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU	:			
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	513,373,617.92		
B. HAZİR DEĞERLER (+)	:	4,582.17		
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00		
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00		
E. BORÇLAR (-)	:	747,041.18		
FON TOPLAM DEĞERİ	:	507,625,235.94		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	:			
Açıklama			Tutarı	
37001 Fon Yönetim Ücreti			668,879.50	

37002	Denetim Ücreti	207.35
370031	SGMK Tahvil Borsa Payı	390.88
370032	O/N RRP Tahvil Borsa Payı	10,172.40
37005	Vergi, Resim ve Harçlar	427.02
37006	Saklama Giderleri	12,046.64
37008	Banka Masrafları	985.13
37015	Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	1,851.07
37021	Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	12,765.99
37028	Portföy Saklama Hizmeti	2,842.00
37030	E-fatura Gideri	118.00
Toplam		710,685.98

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
TRFISGY91916	02.09.2019	5560000.00
TRFGRAN91934	03.09.2019	10000000.00
TRFAKBK919B4	04.09.2019	10000000.00
TRFAKBK919D0	04.09.2019	10000000.00
TRFTEBK91970	06.09.2019	5000000.00
TRFAKFK91937	13.09.2019	2500000.00
TRFISMD91991	13.09.2019	3000000.00
TRFVKFB91973	13.09.2019	15000000.00
TRFFNBK91970	20.09.2019	4000000.00
TRFISGY91924	20.09.2019	1580000.00
TRFTCZB91931	20.09.2019	7000000.00
TRFFNBK91996	27.09.2019	10000000.00

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