YKP

(YBS) YAPI KREDI PORTFOY OZEL SEKTOR BORCLANMA ARACLARI FONU

ARALIK 2019 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	**(YBS) YAPI KREDI PORTFOY OZEL SEKTOR BORCLANMA ARACLARI FONU**
B. KURUCUNUN UNVANI	:	**YKP**
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	**YAPI KREDI PORTFOY YONETIMI A.S.**
Ç. FON TUTARI	:	600,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	669,835,713.72
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	28,229,505,453.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	25.01.2012
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.023728
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.023493
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.00%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	20.13%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	20.13%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		0.00%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		86.19%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		1.92%
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		10.72%
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)		0.00%

Yabancı Hisse Senetleri		0.00%
VIOP Nakit Teminat		0.31%
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%
Katılım Hesabı		0.00%
CC Swap		0.00%
FX Swap		0.00%
IR Swap		0.00%
CD Swap		0.00%
VDMK		0.82%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	:	26.95%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri		30.66%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	:	78.836
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	:	115,438,784.15
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	:	73,823,676.90

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.(DÖVIZ EN.) :			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER :			
F) FİNANSMAN BONOLARI :			
TRFAKBK12023	35,000,000.00	34,989,150.00	5.18
TRFAKBK22022	15,000,000.00	14,790,600.00	2.19
TRFALNF22017	5,000,000.00	4,944,650.00	0.73
TRFDFKT22010	3,000,000.00	2,940,570.00	0.44
TRFDGOZ71915	1,433,429.00	1,433,429.00	0.21
TRFDNFK12014	20,000,000.00	20,136,200.00	2.98
TRFDZBK12058	10,000,000.00	9,931,000.00	1.47
TRFDZBK32023	10,000,000.00	10,039,600.00	1.49
TRFEGYO62014	10,000,000.00	9,573,100.00	1.42
TRFFNBK12034	7,500,000.00	7,458,825.00	1.10
TRFFNBK12042	20,000,000.00	19,849,600.00	2.94
TRFFNBK22025	15,000,000.00	14,805,750.00	2.19
TRFFNBK32032	10,000,000.00	9,783,000.00	1.45

TRFFNYM32014		5,000,000.00	4,894,650.00	0.72
TRFGRAN32011		13,400,000.00	13,521,270.00	2.00
TRFGRAN42010		2,900,000.00	2,911,571.00	0.43
TRFHLFK12019		15,000,000.00	14,925,750.00	2.21
TRFISFN52012		14,630,000.00	14,024,171.70	2.08
TRFISFN52020		20,000,000.00	19,160,800.00	2.84
TRFISGY12011		4,540,000.00	4,526,425.40	0.67
TRFISGY52017		11,500,000.00	10,994,000.00	1.63
TRFISMD12047		14,070,000.00	14,030,181.90	2.08
TRFISMD32052		5,000,000.00	4,900,600.00	0.73
TRFOYMD12019		4,000,000.00	3,990,760.00	0.59
TRFOYMD22018		1,000,000.00	989,870.00	0.15
TRFTCZB32018		19,780,000.00	20,069,183.60	2.97
TRFTCZB32026		3,170,000.00	3,209,117.80	0.47
TRFTCZB82013		8,870,000.00	9,069,841.10	1.34
TRFTHAL22010		7,000,000.00	7,018,900.00	1.04
TRFVFAS32014		15,000,000.00	14,675,550.00	2.17
TRFVFAS42013		10,000,000.00	9,742,400.00	1.44
TRFVKFB22010		40,000,000.00	39,363,200.00	5.82
TRFYAKF32015		10,000,000.00	9,826,200.00	1.45
TRFYKBK32013		10,000,000.00	10,035,600.00	1.49
TRFYKYM12021		5,000,000.00	4,958,050.00	0.73
TRFYKYM22012		5,000,000.00	4,926,000.00	0.73
TRFYKYM22020		3,000,000.00	2,957,280.00	0.44
TOPLAM		409,793,429.00	405,396,846.50	59.99
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:			
TRSAKYP41612		3,253,744.00	3,421,018.98	0.51
TRSARCL22117		5,000,000.00	5,086,550.00	0.75
TRSAYGZ12024		4,890,000.00	5,193,864.60	0.77
TRSAYGZ62110		2,100,000.00	2,093,028.00	0.31
TRSBOLU72119		2,500,000.00	2,563,875.00	0.38
TRSCMSA32112		3,190,000.00	3,204,163.60	0.47
TRSENSA72211		5,000,000.00	7,163,150.00	1.06
TRSERGL52117		3,500,000.00	3,561,565.00	0.53
TRSISGY32111		3,640,000.00	3,649,172.80	0.54
TRSKALE62114		5,000,000.00	4,907,750.00	0.73
TRSKCTF32014		2,000,000.00	2,079,340.00	0.31
TRSKCTY32015		3,410,000.00	3,438,541.70	0.51
TRSKCTY62012		4,000,000.00	4,030,000.00	0.60
TRSKFTF42016		4,800,000.00	4,917,168.00	0.73
TRSKFTF62113		4,000,000.00	4,050,640.00	0.60
TRSKRSNE2018		200,000.00	208,140.00	0.03
TRSOPAS22111		10,900,000.00	11,017,720.00	1.63
TRSOPAS42010		7,000,000.00	7,069,440.00	1.05
TRSORFN72013		3,490,000.00	3,578,995.00	0.53
TRSOTKO12013		5,000,000.00	5,455,150.00	0.81
TRSOTKO32110		5,000,000.00	5,035,850.00	0.75
TRSRNSH22023		5,000,000.00	5,090,050.00	0.75

TRSSRTN72114		2,500,000.00	2,570,900.00	0.38
TRSTBTF32116		10,000,000.00	9,928,800.00	1.47
TRSTHALE2716		3,200,000.00	3,203,136.00	0.47
TRSTISB72712		11,000,000.00	11,245,630.00	1.66
TRSTISB92918		8,000,000.00	7,984,960.00	1.18
TRSTPRS12115		1,000,000.00	1,030,970.00	0.15
TRSTTRK42012		2,740,000.00	2,858,368.00	0.42
TRSVKFB92719		3,000,000.00	3,007,500.00	0.45
TRSYDAT22015		10,000,000.00	10,201,900.00	1.51
TRSYKBK62914		4,500,000.00	4,639,005.00	0.69
TRSYKBK92911		10,000,000.00	10,384,000.00	1.54
TOPLAM		158,813,744.00	163,870,341.68	24.25
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
H) KİRA SERTİFİKALARI	:			
TRD151221T10		1,460,000.00	1,508,910.00	0.22
TRD220921T16		3,000,000.00	4,693,470.00	0.69
TOPLAM		4,460,000.00	6,202,380.00	0.92
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
TRT050624T35		7,245,270.00	8,004,931.51	1.18
TRT061124T11		7,921,835.00	8,004,931.51	1.18
TRT070727T13		1,148,175.00	1,500,924.66	0.22
TRT110827T16		14,925,505.00	14,008,630.14	2.07
TRT120325T12		16,434,535.00	14,008,630.14	2.07
TRT150120T16		157,425.00	165,080.83	0.02
TRT261022T10		11,471,530.00	23,014,178.08	3.41
TRT280628T18		20,558,680.00	24,014,794.52	3.55
TOPLAM		79,862,955.00	92,722,101.39	13.72
L) DİĞER	:			
BPP		343,203.92	343,203.92	0.05
TOPLAM			343,203.92	0.05
M) VARANT	:			
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:			
		2,000,403.25	2,000,403.25	0.30
TOPLAM		2,000,403.25	2,000,403.25	0.30
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
O) VDMK	:			
TRPTYV232410		5,000,000.00	5,229,350.00	0.77
TOPLAM		5,000,000.00	5,229,350.00	0.77
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU	:	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	675,764,626.74
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	6,041.12

C. ALACAKLAR (+)	:	0.00
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	1,080,506.17
FON TOPLAM DEĞERI	:	669,835,713.72

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER :

Açıklama		Tutarı
37001	Fon Yönetim Ücreti	986,132.14
37002	Denetim Ücreti	221.65
370031	SGMK Tahvil Borsa Payı	1,139.16
370032	O/N RRP Tahvil Borsa Payı	17,454.30
37005	Vergi, Resim ve Harçlar	48.00
37006	Saklama Giderleri	12,476.31
37008	Banka Masrafları	927.84
37009	Noter Tasdik ve Ücreti	110.14
37015	Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	161.79
37021	Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	14,765.70
37028	Portföy Saklama Hizmeti	4,095.00
37030	E-fatura Gideri	236.00
Toplam		1,037,768.03

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
TRFISGYA1914	04.12.2019	9110000.00
TRFGRANA1916	12.12.2019	15000000.00
TRFAKYMA1920	16.12.2019	5000000.00
TRFFNBKA1954	20.12.2019	10000000.00
TRFISMDA1952	20.12.2019	10000000.00
TRFAKBKA19L7	24.12.2019	15000000.00
TRFGRANA1957	26.12.2019	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