

YKP
(YOT) YAPI KREDİ PORTFOY ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
ARALIK 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	:	184,781,643.08
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	24,965,056.01
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	29.08.1996
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	7.401611
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	7.304105
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.33%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	24.24%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	24.24%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		72.62%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		13.71%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		1.13%
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		8.56%
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		0.17%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.00%

Yabancı Hisse Senetleri	0.00%
VIOP Nakit Teminat	0.89%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	0.00%
Vadeli_YP	0.00%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	2.64%
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	0.28%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 0.05%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	28.58%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 409.411
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 23,614,309.51
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	: 42,339,404.13

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT020322T17	200,000.00	205,856.00	0.11
TRT050220T17	400,000.00	410,944.00	0.22
TRT080323T10	40,000.00	36,232.40	0.02
TRT080328T15	100,000.00	105,841.00	0.06
TRT080720T19	15,064,000.00	15,666,710.64	8.45
TRT110226T13	5,000,000.00	4,899,000.00	2.64
TRT120122T17	61,000.00	61,713.70	0.03
TRT120325T12	13,000.00	11,436.36	0.01
TRT120820T12	21,500,000.00	24,971,820.00	13.48
TRT140623T19	1,300,000.00	1,485,133.00	0.80
TRT140922T17	92,000.00	88,791.96	0.05
TRT150120T16	2,300,000.00	2,412,102.00	1.30
TRT160920T25	7,500,000.00	6,953,025.00	3.75
TRT170221T12	14,400,000.00	14,902,704.00	8.04
TRT180123T10	6,500,000.00	6,998,550.00	3.78
TRT200324T13	15,000.00	14,880.75	0.01
TRT201021T25	25,000,000.00	26,611,000.00	14.36
TRT210421T14	15,000,000.00	17,336,700.00	9.36

TRT220921T18	10,000,000.00	9,931,000.00	5.36
TRT240227T17	200,000.00	197,952.00	0.11
TRT240724T15	222,000.00	208,604.52	0.11
TRT270923T11	2,641,000.00	2,490,727.10	1.34
TOPLAM	127,548,000.00	136,000,724.43	73.40
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ	:		
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)	:		
E) DÖVİZE ENDEKSİ TAHVİLLER	:		
F) FİNANSMAN BONOLARI	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSARCL22117	1,000,000.00	1,017,310.00	0.55
TRSARCL72112	1,800,000.00	1,851,174.00	1.00
TRSCMSA32112	500,000.00	502,220.00	0.27
TRSENSA72211	2,450,000.00	3,509,943.50	1.89
TRSKCTF32014	1,000,000.00	1,039,670.00	0.56
TRSKCTY32015	100,000.00	100,837.00	0.05
TRSKFTF42016	1,300,000.00	1,331,733.00	0.72
TRSKRSNE2018	1,000,000.00	1,040,700.00	0.56
TRSOPAS22111	1,500,000.00	1,516,200.00	0.82
TRSORFN72013	1,500,000.00	1,538,250.00	0.83
TRSOTKO32110	1,500,000.00	1,510,755.00	0.82
TRSTHALE2716	800,000.00	800,784.00	0.43
TRSTISB72712	100,000.00	102,233.00	0.06
TRSTISB92918	800,000.00	798,496.00	0.43
TRSVKFB92719	2,000,000.00	2,005,000.00	1.08
TRSYKBK62914	2,700,000.00	2,783,403.00	1.50
TRSYKBK92911	1,000,000.00	1,038,400.00	0.56
XS1629734879	3,350,000.00	3,385,258.75	1.83
TOPLAM	24,400,000.00	25,872,367.25	13.96
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
TRD151221T10	850,000.00	878,475.00	0.47
TOPLAM	850,000.00	878,475.00	0.47
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TRT110827T16	4,264,430.00	4,002,465.75	2.16
TRT261022T10	5,486,385.00	11,006,780.82	5.94
TOPLAM	9,750,815.00	15,009,246.57	8.10
L) DİĞER	:		
YPK	2,922,534.00	5,042,607.38	2.72
BPP	288,173.59	288,173.59	0.16
TOPLAM		5,330,780.97	2.88
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		

		1,682,939.36	1,682,939.36	0.91
TOPLAM		1,682,939.36	1,682,939.36	0.91
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
O) VDMK	:			
TRPTYV232410		500,000.00	522,935.00	0.28
TOPLAM		500,000.00	522,935.00	0.28
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	185,297,468.58
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	7,388.98
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	523,214.48
FON TOPLAM DEĞERİ	:	184,781,643.08

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	480,945.20
37002 Denetim Ücreti	761.98
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	686.94
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	4,216.80
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	48.00
37006 Saklama Giderleri	2,451.72
37008 Banka Masrafları	74.16
37009 Noter Tasdik ve Ücreti	110.14
37010 Kap Gideri	155.93
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	236.75
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	3,150.88
37028 Portföy Saklama Hizmeti	2,940.00
37030 E-fatura Gideri	236.00
Toplam	496,014.50

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

Açıklama	Giriş Tarihi	Stok	Kazanılan Nominal
----------	--------------	------	-------------------

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR

8- İTFALAR

Menkul Kıymet Türü	İtf Tarih	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