

YKP
(YHT) YAPI KREDİ PORTFOY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
MAYIS 2020 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	(YHT) YAPI KREDİ PORTFOY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	387,343,250.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	1,120,774,258.92
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	14,332,547,632.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	31.07.2002
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.078198
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.077846
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	0.45%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	3.60%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	14.49%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		43.67%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		42.40%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		0.09%
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		8.10%
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		0.46%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.00%

Yabancı Hisse Senetleri	0.00%
VIOP Nakit Teminat	0.00%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	5.28%
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	0.00%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 29.57%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	66.23%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 83.469
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 988,726,797.44
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	: 1,040,013,850.11

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT071020T23	61,000,000.00	59,487,810.00	5.37
TRT080720T19	105,000,000.00	109,174,800.00	9.86
TRT090621T18	15,000,000.00	13,819,200.00	1.25
TRT100620T16	500,000.00	499,285.00	0.05
TRT120820T12	95,500,000.00	105,002,250.00	9.48
TRT140421T13	40,000,000.00	37,315,200.00	3.37
TRT160920T25	45,000,000.00	44,059,950.00	3.98
TRT170221T12	17,000,000.00	17,837,080.00	1.61
TRT201021T25	1,000,000.00	1,076,810.00	0.10
TRT210421T14	11,500,000.00	13,002,820.00	1.17
TRT220921T18	38,000,000.00	38,879,700.00	3.51
TOPLAM	429,500,000.00	440,154,905.00	39.75
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
TRT220921T18	-15,500,000.00	-15,861,615.00	-1.43
TOPLAM	-15,500,000.00	-15,861,615.00	-1.43
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSİLİ TAHVİLLER			

F) FİNANSMAN BONOLARI	:			
TRFAKBK72050		50,000,000.00	49,646,500.00	4.48
TRFAKBKE2014		20,000,000.00	19,286,600.00	1.74
TRFAKYM72017		7,000,000.00	6,952,820.00	0.63
TRFDNFK72018		20,000,000.00	19,731,000.00	1.78
TRFDZBK72045		25,000,000.00	24,677,000.00	2.23
TRFDZBK92043		20,000,000.00	19,489,200.00	1.76
TRFFNBK92028		10,000,000.00	10,224,100.00	0.92
TRFGRAN62018		44,000,000.00	44,139,920.00	3.99
TRFGRAN72033		25,000,000.00	24,752,500.00	2.24
TRFGRAN72058		20,000,000.00	19,772,000.00	1.79
TRFGRAN72066		5,000,000.00	4,932,200.00	0.45
TRFHLFKE2012		5,500,000.00	5,341,435.00	0.48
TRFISFA92015		5,260,000.00	5,111,562.80	0.46
TRFISFN72010		15,550,000.00	15,378,483.50	1.39
TRFISFN72028		2,670,000.00	2,632,059.30	0.24
TRFMCBFK2019		7,000,000.00	6,724,900.00	0.61
TRFTCZB82013		8,870,000.00	8,877,805.60	0.80
TRFTCZB92012		9,000,000.00	9,164,520.00	0.83
TRFTEBK72012		35,000,000.00	34,649,650.00	3.13
TRFTHAL82048		10,000,000.00	9,838,000.00	0.89
TRFTISB72040		20,000,000.00	19,834,200.00	1.79
TRFTISB72081		40,000,000.00	39,668,000.00	3.58
TRFVFAS72010		10,000,000.00	9,920,200.00	0.90
TRFVKFB72080		14,720,000.00	14,542,771.20	1.31
TRFVKFB82022		10,000,000.00	10,031,600.00	0.91
TRFVKFB92013		10,000,000.00	10,049,000.00	0.91
TRFVKFB92039		6,700,000.00	6,547,039.00	0.59
TRFYKBK62028		10,000,000.00	10,161,100.00	0.92
TRFYKBK72035		15,000,000.00	14,788,950.00	1.34
TRFYKBK82026		25,000,000.00	25,017,500.00	2.26
TRFYKBK82042		12,000,000.00	11,814,120.00	1.07
TRFYKBK82067		15,000,000.00	14,745,900.00	1.33
TOPLAM		533,270,000.00	528,442,636.40	47.72
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:			
TRSARCL22117		3,000,000.00	3,065,400.00	0.28
TRSARCL72112		9,010,000.00	9,279,489.10	0.84
TRISGY32111		4,550,000.00	4,666,116.00	0.42
TRSOPAS22111		9,400,000.00	9,425,380.00	0.85
TRSOTKO32110		5,000,000.00	5,205,150.00	0.47
TRSOTKO72116		9,500,000.00	9,509,975.00	0.86
TRSTISB72712		5,000,000.00	5,053,000.00	0.46
TRSVKFB92719		5,000,000.00	5,447,800.00	0.49
TOPLAM		50,460,000.00	51,652,310.10	4.66
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
H) KİRA SERTİFİKALARI	:			
TRD100221T17		110,000.00	122,892.00	0.01
TRD100822T10		160,000.00	170,784.00	0.02

TRD140721T18	140,000.00	146,797.00	0.01
TRD160621T17	80,000.00	97,985.60	0.01
TRD260122T19	470,000.00	493,114.60	0.04
TRDHVKA62019	10,000.00	10,469.90	0.00
TRDHVKA62043	10,000.00	10,309.70	0.00
TRDHVKA72018	10,000.00	10,330.90	0.00
TOPLAM	990,000.00	1,062,683.70	0.10
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TRT060121T16	1,980.00	5,001.99	0.00
TRT210721T11	11,511,881.00	28,019,814.79	2.53
TRT220921T18	7,815,324.00	8,005,661.37	0.72
TOPLAM	19,329,185.00	36,030,478.15	3.25
L) DİĞER	:		
Vadeli Mevduat gün 35	10,000,000.00	10,078,893.44	0.91
Vadeli Mevduat gün 39	20,000,000.00	20,157,716.03	1.82
Vadeli Mevduat gün 45	10,000,000.00	10,088,125.97	0.91
Vadeli Mevduat gün 45	10,330,284.15	10,403,230.19	0.94
Vadeli Mevduat gün 45	5,058,743.17	5,083,057.86	0.46
BPP	10,076,273.97	10,043,924.43	0.91
TOPLAM		65,854,947.92	5.95
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
O) VDMK	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU	:		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	1,107,336,346.27	
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	14,418.09	
C. ALACAKLAR (+)	:	15,862,145.62	
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00	
E. BORÇLAR (-)	:	2,438,651.06	
FON TOPLAM DEĞERİ	:	1,120,774,258.92	
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	:		
Açıklama		Tutarı	
37001 Fon Yönetim Ücreti		2,121,672.36	
37002 Denetim Ücreti		813.68	
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı		5,574.00	
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı		22,541.06	
37005 Vergi, Resim ve Harçlar		371.10	
37006 Saklama Giderleri		18,886.30	
37008 Banka Masrafları		830.92	

37010	Kap Gideri	304.92
370142	KYD Endeks Lisans Giderleri	1,911.60
37015	Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	1,344.00
37021	Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	17,779.28
37028	Portföy Saklama Hizmeti	4,025.00
37030	E-fatura Gideri	118.00
37099	Diğer Giderler	274.68
Toplam		2,196,446.90

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	İtfat Tarihi	Nominal
TRFFNBK52014	08.05.2020	5000000.00
TRDHVKA52036	08.05.2020	10000.00
TRFTISB52018	11.05.2020	28450000.00
TRT130520T14	13.05.2020	3000000.00
TRFISFN52012	15.05.2020	5000000.00
TRFAKBK52037	18.05.2020	20000000.00
TRFAKBK52037	18.05.2020	30000000.00
TRFISGY52017	29.05.2020	2860000.00

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
------------------------	---------------	---------	-------------	--------------------