

YKP
(YBS) YAPI KREDİ PORTFOY ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
AĞUSTOS 2020 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	(YBS) YAPI KREDİ PORTFOY ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFOY YÖNETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	600,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	792,248,851.64
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	31,445,717,483.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	25.01.2012
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER TL

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.025194
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.025034
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	0.64%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	6.18%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	11.40%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		0.06%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		83.08%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		5.84%
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		6.62%
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		0.11%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.00%

Yabancı Hisse Senetleri	0.00%
VIOP Nakit Teminat	1.15%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	2.40%
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	0.73%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	31.46%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	32.29%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	106.965
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	37,069,772.99
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	40,423,164.07

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT260122T11	500,000.00	505,090.00	0.06
TOPLAM	500,000.00	505,090.00	0.06
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFAKBK12148	3,200,000.00	3,073,120.00	0.39
TRFAKBK121B7	5,000,000.00	5,084,900.00	0.64
TRFAKBKA2026	23,000,000.00	22,353,470.00	2.80
TRFAKYM92015	10,000,000.00	9,938,700.00	1.25
TRFDGOZ71915	1,254,742.00	1,254,742.00	0.16
TRFDNFK92016	20,000,000.00	19,898,600.00	2.49
TRFDNFKE2022	10,000,000.00	9,911,200.00	1.24
TRFDZBK92019	10,000,000.00	10,210,200.00	1.28
TRFDZBK92043	30,000,000.00	29,838,600.00	3.74
TRFDZYO92013	10,000,000.00	9,927,100.00	1.24
TRFFFKRK2010	4,000,000.00	3,913,960.00	0.49

TRFFINFK2018	13,000,000.00	12,724,660.00	1.59
TRFFNBK92036	10,000,000.00	10,182,800.00	1.28
TRFFNBKK2026	10,000,000.00	9,733,500.00	1.22
TRFGRAN92023	15,000,000.00	15,046,500.00	1.89
TRFGRANA2047	15,000,000.00	15,026,400.00	1.88
TRFGRANE2027	20,000,000.00	20,045,000.00	2.51
TRFGRFA12118	14,000,000.00	13,549,200.00	1.70
TRFGRFAA2013	7,500,000.00	7,259,475.00	0.91
TRFHLFKE2012	9,500,000.00	9,436,065.00	1.18
TRFISFA92015	5,260,000.00	5,228,966.00	0.66
TRFISFAK2018	27,000,000.00	26,212,950.00	3.28
TRFKFTFE2016	5,000,000.00	4,953,500.00	0.62
TRFMCBFK2019	7,000,000.00	6,874,140.00	0.86
TRFOYMDE2026	6,000,000.00	5,908,980.00	0.74
TRFTCZB92012	4,000,000.00	4,075,080.00	0.51
TRFTCZBE2016	30,000,000.00	30,042,000.00	3.76
TRFTEBK22140	8,000,000.00	7,656,000.00	0.96
TRFTEBK32131	7,000,000.00	7,133,490.00	0.89
TRFTEBK42114	20,000,000.00	19,776,200.00	2.48
TRFTEBK42130	15,000,000.00	15,059,100.00	1.89
TRFTHALK2028	15,000,000.00	15,079,050.00	1.89
TRFVKFB92013	5,000,000.00	5,045,625.00	0.63
TRFVKFB92039	6,700,000.00	6,695,109.00	0.84
TRFVKFBA2010	6,000,000.00	5,858,820.00	0.73
TRFVKFBK2059	30,000,000.00	30,158,100.00	3.78
TRFYAKFE2014	5,000,000.00	4,913,300.00	0.62
TRFYKKBK12148	5,000,000.00	5,015,850.00	0.63
TRFYKBKA2010	10,000,000.00	10,077,100.00	1.26
TRFYKBKA2036	5,000,000.00	5,026,150.00	0.63
TRFYKBKE2032	5,000,000.00	4,939,400.00	0.62
TRFYKYM92015	4,200,000.00	4,189,710.00	0.52
TOPLAM	471,614,742.00	468,326,812.00	58.67
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSAKFH22212	7,000,000.00	7,049,420.00	0.88
TRSAKYP41612	3,253,744.00	3,421,018.98	0.43
TR SARCL22117	5,000,000.00	5,103,150.00	0.64
TR SAYGZ62110	2,100,000.00	2,109,219.00	0.26
TRSBOLU72119	2,500,000.00	2,523,075.00	0.32
TRSCMSA32112	3,190,000.00	3,248,153.70	0.41
TR SDEVA42219	6,000,000.00	6,106,380.00	0.77
TR SENSEA72211	5,000,000.00	7,740,100.00	0.97
TR SERGL52117	3,500,000.00	3,499,195.00	0.44
TRSGRAN23013	11,250,000.00	11,638,350.00	1.46
TR SISGY32111	3,640,000.00	3,718,988.00	0.47
TR SKALE62114	5,000,000.00	5,124,200.00	0.64
TR SKCTFA2117	19,000,000.00	19,338,580.00	2.42
TR SKFTF62113	4,000,000.00	4,070,280.00	0.51
TR SKFTFA2114	9,000,000.00	9,178,110.00	1.15

TRSKRSNE2018	200,000.00	205,018.00	0.03
TRSOPAS22111	10,900,000.00	11,010,090.00	1.38
TRSOPAS22129	10,000,000.00	10,066,800.00	1.26
TRSOTKO32110	5,000,000.00	5,093,600.00	0.64
TRSSRTN72114	2,500,000.00	2,530,300.00	0.32
TRSTBTF32116	10,000,000.00	10,039,700.00	1.26
TRSTHALE2716	3,200,000.00	3,215,200.00	0.40
TRSTISB22212	10,000,000.00	10,032,400.00	1.26
TRSTISB72712	11,000,000.00	11,149,490.00	1.40
TRSTISB92918	8,000,000.00	8,174,080.00	1.02
TRSTPRS12115	3,000,000.00	3,015,480.00	0.38
TRSVKFB92719	3,000,000.00	3,256,860.00	0.41
TRSYAZI52216	14,000,000.00	14,107,100.00	1.77
TRSYKBK32115	10,000,000.00	10,013,200.00	1.25
TRSYKBK62914	4,500,000.00	4,517,370.00	0.57
TRSYKBK92911	10,000,000.00	10,130,500.00	1.27
TOPLAM	204,733,744.00	210,425,407.68	26.36
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
TRD100822T10	100,000.00	101,371.00	0.01
TRD140721T18	5,100,000.00	5,010,648.00	0.63
TRD151221T10	13,310,000.00	13,913,209.20	1.74
TRD160621T17	8,560,000.00	9,526,338.40	1.19
TRD180821T13	4,100,000.00	4,222,918.00	0.53
TRD220921T16	1,000,000.00	1,692,080.00	0.21
TRD260122T19	17,900,000.00	18,061,995.00	2.26
TRDHVKA92016	110,000.00	114,828.89	0.01
TOPLAM	50,180,000.00	52,643,388.49	6.60
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TRT040522T13	11,705,460.00	11,003,013.70	1.38
TRT050527T17	16,879,760.00	16,504,520.55	2.07
TRT280628T18	2,420,200.00	3,500,958.90	0.44
TOPLAM	31,005,420.00	31,008,493.15	3.88
L) DİĞER	:		
Vadeli Mevduat gün 35	4,000,000.00	4,025,438.58	0.50
Vadeli Mevduat gün 94	15,810,387.63	15,948,524.53	2.00
BPP	242,069.62	242,069.62	0.03
TOPLAM		20,216,032.73	2.53
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		
	9,242,891.44	9,242,891.44	1.16
TOPLAM	9,242,891.44	9,242,891.44	1.16
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
O) VDMK	:		

TRPTYV232410	5,000,000.00	5,838,600.00	0.73
TOPLAM	5,000,000.00	5,838,600.00	0.73
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU :

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	798,206,715.49
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	5,461.30
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	1,287,564.18
FON TOPLAM DEĞERİ	:	792,248,851.64

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER :

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	1,106,549.61
37002 Denetim Ücreti	966.00
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	950.76
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	12,042.08
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	150.50
37006 Saklama Giderleri	25,036.56
37008 Banka Masrafları	968.65
37010 Kap Gideri	314.03
370142 KYD Endeks Lisans Giderleri	1,752.30
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	579.79
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	12,295.28
37023 VIOP İşlemi Komisyonu	46,604.99
37028 Portföy Saklama Hizmeti	4,508.00
37099 Diğer Giderler	217.28
Toplam	1,212,935.83

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	İtfa Tarihi	Nominal
TRFGRFA82012	04.08.2020	15460000.00
TRFYKBK82042	04.08.2020	10000000.00
TRFDFKT82014	12.08.2020	3000000.00
TRFDZBK82036	14.08.2020	20000000.00
TRFTHAL82030	14.08.2020	7000000.00
TRFVKFB82022	14.08.2020	15000000.00
TRFYKBK82067	14.08.2020	10000000.00
TRFYKBK82026	21.08.2020	10000000.00

TRFAKYM82016	24.08.2020	20000000.00
TRFOYMD82012	27.08.2020	6000000.00
TRFTCZB82013	27.08.2020	8870000.00
TRFTCZB82021	27.08.2020	19000000.00
TRFISFA82024	28.08.2020	16590000.00
TRFISGY82014	28.08.2020	5140000.00
TRFVFAS82019	28.08.2020	14280000.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR :

10- ÖDÜNÇ İŞLEMLER :

A) ÖDÜNÇ VERİLEN :

Sermaye Piyasası Aracı :

B) ÖDÜNÇ ALINAN :

Sermaye Piyasası Aracı :

Menkul Kıymet

Nominal

Vade Tarihi

Cari Piyasa Değeri

Menkul Kıymet

Nominal

Vade Tarihi

Cari Piyasa Değeri