

YKP
(YHT) YAPI KREDİ PORTFOY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
ŞUBAT 2019 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	:	615,941,082.94
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	9,470,692,982.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	31.07.2002
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.065037
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.064083
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.49%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	3.22%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	18.00%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		23.60%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		59.66%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		0.25%
Kira Sertifikası-Kamu-YP		0.00%
Kira Sertifikası-Özel Sektör-TL		0.14%
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%
Devlet Tahvili Ters Repo		10.87%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		2.36%
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	1.01%
Vadeli_YP	1.63%
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	0.49%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	20.30%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	40.31%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	92.637
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	616,357,968.25
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	557,731,582.06

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT050220T17	15,100,000.00	13,769,992.00	2.23
TRT100719T18	23,000,000.00	22,423,390.00	3.63
TRT120820T12	500,000.00	535,930.00	0.09
TRT131119T19	18,300,000.00	18,279,504.00	2.96
TRT150120T16	11,500,000.00	10,902,575.00	1.77
TRT150519T15	43,800,000.00	44,428,968.00	7.20
TRT270319T13	18,200,000.00	18,888,506.00	3.06
TOPLAM	130,400,000.00	129,228,865.00	20.94
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFAKBK41972	25,000,000.00	24,432,750.00	3.96
TRFAKFK31925	4,500,000.00	4,488,750.00	0.73
TRFAKFK41916	11,700,000.00	11,468,808.00	1.86
TRFAKFK41924	10,000,000.00	9,673,200.00	1.57
TRFAKYM31914	10,000,000.00	9,832,800.00	1.59
TRFAKYM31922	9,500,000.00	9,340,590.00	1.51
TRFDFKT31912	3,500,000.00	3,700,525.50	0.60
TRFFFKR31929	3,000,000.00	2,980,290.00	0.48
TRFFNBK31935	8,000,000.00	7,966,880.00	1.29

TRFFNBK41934	8,000,000.00	7,775,840.00	1.26
TRFFNBK41959	5,000,000.00	4,840,200.00	0.78
TRFFNBK51925	5,000,000.00	4,803,650.00	0.78
TRFFNBK71915	18,000,000.00	16,618,860.00	2.69
TRFGRFA41927	2,000,000.00	1,942,000.00	0.31
TRFGRFA41935	5,000,000.00	4,902,600.00	0.79
TRFGRFA51918	8,490,000.00	8,191,152.00	1.33
TRFHALK51919	10,000,000.00	9,542,400.00	1.55
TRHFHAS41915	10,000,000.00	9,716,100.00	1.57
TRFHLFK51918	5,000,000.00	4,793,500.00	0.78
TRFISFA41921	2,190,000.00	2,122,022.40	0.34
TRFISFA51912	10,000,000.00	9,550,800.00	1.55
TRFISFN31917	7,450,000.00	7,401,649.50	1.20
TRFISFN31925	6,850,000.00	6,778,417.50	1.10
TRFISFN41957	6,500,000.00	6,318,260.00	1.02
TRFISFN51915	10,750,000.00	10,307,100.00	1.67
TRFISFN51923	9,000,000.00	8,551,800.00	1.39
TRFISMD31955	10,000,000.00	9,940,500.00	1.61
TRFISMD31997	15,000,000.00	14,881,800.00	2.41
TRFISMD319F8	10,000,000.00	9,885,300.00	1.60
TRFISMD319G6	10,000,000.00	9,875,800.00	1.60
TRFISMD41970	5,000,000.00	4,891,150.00	0.79
TRFISMD419A7	5,000,000.00	4,880,850.00	0.79
TRFKCTY41914	3,250,000.00	3,171,512.50	0.51
TRFOTKO41910	5,880,000.00	5,685,901.20	0.92
TRFVFAS61914	15,000,000.00	14,010,300.00	2.27
TRFYAKF41917	4,000,000.00	3,895,480.00	0.63
TRFYKBK41915	13,500,000.00	13,178,700.00	2.14
TRFYKBK41923	10,000,000.00	9,803,900.00	1.59
TRFYKFK41916	9,000,000.00	8,779,230.00	1.42
TRFYKFK41924	10,000,000.00	9,714,600.00	1.57
TRFYKFK51915	3,200,000.00	3,081,888.00	0.50
TRFYKYM31914	5,000,000.00	4,942,900.00	0.80
TRFYKYM41921	6,000,000.00	5,832,900.00	0.95
TRFYKYM51912	6,000,000.00	5,724,840.00	0.93
TOPLAM	360,260,000.00	350,218,496.60	56.75
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSARCL22117	3,000,000.00	3,028,290.00	0.49
TRSAYGZE1914	2,600,000.00	2,731,040.00	0.44
TRSCCLKM31910	300,000.00	337,059.00	0.05
TRSGFYH31914	4,530,000.00	4,715,367.60	0.76
TRISISGY32111	4,550,000.00	4,693,507.00	0.76
TRSKCTF32014	1,000,000.00	1,007,420.00	0.16
TRSKFTF42016	4,200,000.00	4,162,158.00	0.67
TRSOPAS22111	9,300,000.00	9,200,118.00	1.49
TRSOPAS42010	5,000,000.00	5,273,150.00	0.85
TRSOTKO81919	6,150,000.00	5,937,579.00	0.96
TRSRNSH22023	5,000,000.00	5,033,900.00	0.82

TRSTISB72712	5,000,000.00	5,061,050.00	0.82
TRSVKFB92719	5,000,000.00	5,207,600.00	0.84
TOPLAM	55,630,000.00	56,388,238.60	9.14
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
TRD100221T17	150,000.00	151,741.50	0.02
TRD120220T16	1,010,000.00	981,467.50	0.16
TRD220921T16	240,000.00	336,571.20	0.05
TRD230920T24	60,000.00	72,467.40	0.01
TRDHVKA41914	10,000.00	10,529.80	0.00
TRDHVKA41922	10,000.00	10,471.60	0.00
TRDKTSK61920	1,000,000.00	1,009,250.00	0.16
TRDZKBV41914	200,000.00	207,846.00	0.03
TOPLAM	2,680,000.00	2,780,345.00	0.45
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TRT050624T19	9,101,075.00	9,006,041.10	1.46
TRT150519T15	52,234.00	53,031.65	0.01
TRT150519T15	45,334,493.00	46,031,002.74	7.46
TOPLAM	54,487,802.00	55,090,075.49	8.93
L) DİĞER	:		
Forward EURO/TL	-2,000,000.00		
Vadeli Mevduat YP gün 45	2,000,000.00	12,127,391.28	1.97
Vadeli Mevduat gün 41	3,000,000.00	3,035,955.10	0.49
BPP	5,109,917.81	5,090,543.62	0.82
TOPLAM		20,253,890.00	3.28
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
O) VDMK	:		
TRPKYVFA2318	3,000,000.00	3,203,580.00	0.52
TOPLAM	3,000,000.00	3,203,580.00	0.52
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU	:		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	617,163,490.69	
B. HAZİR DEĞERLER (+)	:	9,697.14	
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00	
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00	
E. BORÇLAR (-)	:	1,232,104.89	
FON TOPLAM DEĞERİ	:	615,941,082.94	
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	:		
Açıklama		Tutarı	

37001	Fon Yönetim Ücreti	1,111,192.70
37002	Denetim Ücreti	708.40
370031	SGMK Tahvil Borsa Payı	1,177.48
370032	O/N RRP Tahvil Borsa Payı	17,930.14
37005	Vergi, Resim ve Harçlar	3,266.54
37006	Saklama Giderleri	12,572.82
37008	Banka Masrafları	1,409.72
37010	Kap Gideri	238.84
370142	KYD Endeks Lisans Giderleri	1,486.80
37015	Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	915.60
37021	Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	10,204.80
37028	Portföy Saklama Hizmeti	3,927.00
37030	E-fatura Gideri	118.00
37099	Diğer Giderler	132.72
Toplam		1,165,281.56

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
TRFFNBK21928	01.02.2019	5000000.00
TRFGRFA21911	01.02.2019	5000000.00
TRFYKBK21925	06.02.2019	10000000.00
TRFISMD21956	08.02.2019	5000000.00
TRFAKFK21918	11.02.2019	6000000.00
TRFYKYM21915	13.02.2019	13010000.00
TRD130219T18	13.02.2019	520000.00
TRFAKBK21917	15.02.2019	10000000.00
TRFISMD21964	15.02.2019	5000000.00
TRFVKFB21921	15.02.2019	10000000.00
TRDZKVK21917	15.02.2019	370000.00
TRT200219T11	20.02.2019	13000000.00
TRFHFAS21917	20.02.2019	9990000.00

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