

YKP**(YBE) YAPI KREDİ PORTFOY EUROBOND (DOLAR) BORCLANMA ARAÇLARI FONU****ŞUBAT 2019 AYLIK RAPORUDUR.****1- FONU TANITICI BİLGİLER**

A. FONUN ADI	:	(YBE) YAPI KREDİ PORTFOY EUROBOND (DOLAR) BORCLANMA ARAÇLARI FONU
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	1,000,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	1,305,101,487.06
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	9,136,023,402.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	29.06.2000
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.142852
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.138265
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	3.32%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	5.05%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	35.62%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		5.95%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		3.56%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		0.00%
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%
Devlet Tahvili Ters Repo		0.19%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		2.24%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		83.20%
Yabancı Hisse Senetleri		0.00%
VIOP Nakit Teminat		0.49%

Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	0.00%
Vadeli_YP	3.71%
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	0.67%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	18.07%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	2.46%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	2511.005
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	29,515,061.36
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	59,944,664.96

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.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSİLİ TAHVİLLER			
TRT150121F11	12,510,000.00	76,430,015.54	5.79
TOPLAM	12,510,000.00	76,430,015.54	5.79
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFDGOZ71915	1,844,640.00	1,844,640.00	0.14
TOPLAM	1,844,640.00	1,844,640.00	0.14
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ			
TRSAYGZ12024	3,500,000.00	3,153,815.00	0.24
TRSKCTF32014	5,000,000.00	5,037,100.00	0.38
TRSKCTF71913	5,000,000.00	4,944,950.00	0.37
TRSKFTF42016	4,800,000.00	4,756,752.00	0.36
TRSKRSNE2018	400,000.00	402,612.00	0.03
TRSOPAS22012	2,000,000.00	2,007,040.00	0.15
TRSOPAS42010	8,000,000.00	8,437,040.00	0.64
TRSOTKO12013	5,000,000.00	5,080,350.00	0.38
TRSOTKO22012	5,000,000.00	5,004,000.00	0.38
TRSRNSH22023	2,000,000.00	2,013,560.00	0.15
TRSTIMGE1918	1,000,000.00	998,540.00	0.08

TOPLAM	41,700,000.00	41,835,759.00	3.17
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
US900123AL40	6130000.00	45162044.77	3.42
US900123AT75	18560000.00	106622335.40	8.07
US900123AW05	5040000.00	28298189.47	2.14
US900123AY60	29480000.00	156380935.97	11.84
US900123BB58	11201000.00	61783193.68	4.68
US900123BG46	9700000.00	49755440.27	3.77
US900123BJ84	12655000.00	59215323.60	4.48
US900123BZ27	10000000.00	55527423.40	4.20
US900123CG37	3500000.00	17273843.85	1.31
US900123CK49	500000.00	2461470.27	0.19
US900123CL22	7000000.00	36709465.70	2.78
US900123CM05	17000.00	77387.24	0.01
US900123CQ19	13000000.00	67421549.58	5.10
US900123CT57	4200000.00	23621691.36	1.79
XS0847042024	5098000.00	25870724.30	1.96
XS0849728190	200000.00	1024779.28	0.08
XS1003016018	115000.00	602937.31	0.05
XS1063442484	50000.00	272601.26	0.02
XS1117601796	1000000.00	5396401.96	0.41
XS1175854923	6050000.00	31012120.48	2.35
XS1376681067	4335000.00	23713252.18	1.80
XS1390320981	2000000.00	10484590.03	0.79
XS1396282177	7800000.00	41282698.34	3.13
XS1508390090	980000.00	5071551.64	0.38
XS1551747733	5700000.00	28909920.66	2.19
XS1578203462	6770000.00	33824398.88	2.56
XS1584113184	14254000.00	70126494.36	5.31
XS1623796072	1300000.00	6130664.66	0.46
XS1750996206	8690000.00	42475824.04	3.22
XS1788516679	5200000.00	27265464.48	2.06
XS1917720911	300000.00	1678106.59	0.13
TOPLAM	200,825,000.00	1,065,452,825.00	80.66
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TRT150519T15	9,150,000.00	9,005,794.52	0.68
TRT150519T15	18,300,005.00	18,011,593.97	1.36
TRT190521T17	19,914,505.00	20,012,876.71	1.52
TOPLAM	47,364,510.00	47,030,265.20	3.56
L) DİĞER	:		
Forward EURO/USD	-1,500,000.00		
Forward EURO/USD	-3,500,000.00		
Forward EURO/USD	-6,000,000.00		
Forward EURO/USD	-1,000,000.00		

YPL	325,000.00	1,807,717.55	0.14
Vadeli Mevduat YP gün 1	6,904,254.30	36,718,525.15	2.78
Vadeli Mevduat YP gün 1	1,502,600.00	7,990,463.60	0.60
Vadeli Mevduat YP gün 35	5,000,000.00	26,649,642.97	2.02
BPP	320,201.64	320,201.64	0.02
TOPLAM		73,486,550.91	5.56
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		
	6,251,419.97	6,251,419.97	0.47
TOPLAM	6,251,419.97	6,251,419.97	0.47
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
O) VDMK	:		
TRPKYVFA2318	8,000,000.00	8,542,880.00	0.65
TOPLAM	8,000,000.00	8,542,880.00	0.65
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	1,320,874,355.62
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	5,173.15
C. ALACAKLAR (+)	:	185,390.98
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	14,118,792.69
FON TOPLAM DEĞERİ	:	1,305,101,487.06

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	2,919,893.78
37002 Denetim Ücreti	708.12
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	58.65
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	396.67
370034 Yabancı Menkul Komisyonu	126.88
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	5,010.58
37006 Saklama Giderleri	13,035.49
37008 Banka Masrafları	474.26
37010 Kap Gideri	238.84
370142 KYD Endeks Lisans Giderleri	1,362.90
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	19,037.30
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	19,750.58
37023 VIOP İşlemi Komisyonu	31,346.26
37028 Portföy Saklama Hizmeti	3,927.00
37030 E-fatura Gideri	118.00
37098 Küsürat farkları	2.19
37099 Diğer Giderler	132.72
Toplam	3,015,620.22

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

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