

YKP
(YOT) YAPI KREDİ PORTFOY ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
ŞUBAT 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	:	146,994,448.53
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	23,835,579.01
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	29.08.1996
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	6.167018
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	6.112760
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	0.89%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	3.52%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	15.50%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		62.03%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		21.19%
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		3.82%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		0.25%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.00%
Yabancı Hisse Senetleri		0.00%
VIOP Nakit Teminat		2.74%

Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	1.52%
Vadeli_YP	1.84%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	4.79%
Katılma Belgesi YP	0.00%
CC Swap	0.00%
FX Swap	0.00%
IR Swap	0.00%
VDMK	1.81%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 0.05%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	65.86%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 435.986
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 2,873,788.45
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	: 8,259,096.13

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT020322T17	1,200,000.00	1,122,348.00	0.76
TRT050220T17	21,900,000.00	19,971,048.00	13.55
TRT080323T10	90,000.00	70,367.40	0.05
TRT080328T15	100,000.00	95,558.00	0.06
TRT080720T19	12,064,000.00	10,972,208.00	7.45
TRT100719T18	1,531,000.00	1,492,617.83	1.01
TRT110226T13	11,000,000.00	9,058,170.00	6.15
TRT120122T17	61,000.00	51,947.60	0.04
TRT120325T12	13,000.00	9,865.70	0.01
TRT120820T12	12,000,000.00	12,862,320.00	8.73
TRT131119T19	5,800,000.00	5,793,504.00	3.93
TRT140623T19	2,300,000.00	2,419,163.00	1.64
TRT140922T17	92,000.00	77,924.92	0.05
TRT150120T16	24,300,000.00	23,037,615.00	15.63
TRT150519T15	300,000.00	304,308.00	0.21
TRT170221T12	2,400,000.00	2,149,824.00	1.46
TRT180123T10	2,000,000.00	1,819,560.00	1.23
TRT200324T13	515,000.00	451,794.05	0.31
TRT240227T17	200,000.00	176,804.00	0.12
TRT240724T15	222,000.00	174,281.10	0.12
TRT270923T11	141,000.00	116,200.92	0.08
TOPLAM	98,229,000.00	92,227,429.52	62.59

VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ	:			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)	:			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER	:			
F) FİNANSMAN BONOLARI	:			
TRFDKKT31912		1,000,000.00	1,057,293.00	0.72
TOPLAM		1,000,000.00	1,057,293.00	0.72
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:			
TRSAFKK1910		2,500,000.00	3,380,550.00	2.29
TR SARCL22117		1,000,000.00	1,009,430.00	0.69
TR SCLKM31910		2,100,000.00	2,359,413.00	1.60
TR SENSEA72211		2,750,000.00	3,417,397.50	2.32
TRSGFYH31914		2,270,000.00	2,362,888.40	1.60
TRSIGYE1915		750,000.00	756,982.50	0.51
TRSKCTF32014		1,000,000.00	1,007,420.00	0.68
TRSKCTF41916		500,000.00	492,575.00	0.33
TRSKCTY32015		100,000.00	105,537.00	0.07
TRSKFTF42016		1,300,000.00	1,288,287.00	0.87
TRSKRSNE2018		1,000,000.00	1,006,530.00	0.68
TR SOPAS22111		1,500,000.00	1,483,890.00	1.01
TRSORFN72013		1,500,000.00	1,514,820.00	1.03
TRSRNSHE1916		1,000,000.00	1,030,840.00	0.70
TRSTBTF31910		800,000.00	800,000.00	0.54
TRSTBTF31928		510,000.00	504,527.70	0.34
TRSTHALE2716		800,000.00	806,968.00	0.55
TRSTIMG41917		530,000.00	539,640.70	0.37
TRSTISB72712		100,000.00	101,221.00	0.07
TRSVKFB92719		2,000,000.00	2,083,040.00	1.41
XS1629734879		3,350,000.00	3,167,743.25	2.15
TOPLAM		27,360,000.00	29,219,701.05	19.83
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
H) KİRA SERTİFİKALARI	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
TRT050624T19		6,067,380.00	6,004,027.40	4.07
TOPLAM		6,067,380.00	6,004,027.40	4.07
L) DİĞER	:			
Forward EURO/TL		-450,000.00		
YPK		4,842,631.00	7,063,049.95	4.79
Vadeli Mevduat YP gün 45		450,000.00	2,728,663.00	1.85
Vadeli Mevduat gün 41		2,200,000.00	2,226,367.08	1.51
F_XAUTRYM0419		10,000.00	2,353,500.00	
BPP		102,064.13	102,064.13	0.07
TOPLAM			12,120,144.17	8.22
M) VARANT	:			

N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:			
		4,062,768.82	4,062,768.82	2.76
TOPLAM		4,062,768.82	4,062,768.82	2.76
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
O) VDMK	:			
TRPKYVFA2318		2,500,000.00	2,669,650.00	1.81
TOPLAM		2,500,000.00	2,669,650.00	1.81
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	147,361,013.96
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	4,771.91
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	371,337.34
FON TOPLAM DEĞERİ	:	146,994,448.53

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	333,727.58
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	1,095.01
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	1,428.00
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	187.09
37006 Saklama Giderleri	2,348.00
37008 Banka Masrafları	527.29
37010 Kap Gideri	140.84
370142 KYD Endeks Lisans Giderleri	1,150.50
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	241.83
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	2,257.44
37023 VIOP İşlemi Komisyonu	3,700.09
37028 Portföy Saklama Hizmeti	2,789.50
37030 E-fatura Gideri	118.00
Toplam	349,711.17

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
TRFGRFA21911	01.02.2019	2000000.00
TRFKFTF21918	01.02.2019	1440000.00
TRSNLOG21912	13.02.2019	100000.00

TRSNLOG21912	13.02.2019	1000000.00
TRSZFKL21916	14.02.2019	1760000.00
TRT200219T11	20.02.2019	400000.00
TRT200219T11	20.02.2019	5600000.00

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