

YKP
(YHT) YAPI KREDİ PORTFOY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
TEMMUZ 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	:	604,234,921.62
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	8,503,793,206.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	31.07.2002
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.071055
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.069546
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	2.17%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	12.77%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	22.52%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		26.29%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		56.89%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		0.43%
Kira Sertifikası-Kamu-YP		0.00%
Kira Sertifikası-Özel Sektör-TL		0.71%
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		13.87%
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		0.00%
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	1.82%
Vadeli_YP	0.00%
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	0.00%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	14.08%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	83.58%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	89.610
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	548,956,510.77
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	410,997,464.16

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRB091019T16	30,000,000.00	29,086,500.00	4.81
TRT050220T17	7,600,000.00	7,531,752.00	1.24
TRT080720T19	12,000,000.00	11,374,080.00	1.88
TRT100620T16	15,000,000.00	13,111,050.00	2.17
TRT130520T14	41,500,000.00	36,686,000.00	6.06
TRT131119T19	68,300,000.00	69,424,218.00	11.47
TRT150120T16	38,500,000.00	37,617,965.00	6.21
TOPLAM	212,900,000.00	204,831,565.00	33.84
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSİLİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFAKBK819A8	15,000,000.00	14,925,300.00	2.47
TRFAKBK919B4	10,000,000.00	9,798,300.00	1.62
TRFAKFK91937	8,500,000.00	8,281,975.00	1.37
TRFAKFK91945	10,000,000.00	9,806,900.00	1.62
TRFDFKT81917	2,000,000.00	1,964,100.00	0.32
TRFFFKR81916	4,000,000.00	3,987,560.00	0.66
TRFFNBK91913	14,990,000.00	14,714,333.90	2.43

TRFFNBK91970	14,390,000.00	14,025,069.60	2.32
TRFFNBKE1919	10,000,000.00	9,671,500.00	1.60
TRFGRAN81976	14,990,000.00	14,774,743.60	2.44
TRFGRAN91959	10,000,000.00	9,773,100.00	1.61
TRFGRFAE1912	5,000,000.00	4,740,650.00	0.78
TRFGRFAK1914	9,600,000.00	8,983,296.00	1.48
TRFGRFK81930	10,490,000.00	10,349,958.50	1.71
TRFISFAK1911	10,720,000.00	10,194,720.00	1.68
TRFISFN81938	18,000,000.00	17,910,540.00	2.96
TRFISFNE1914	3,120,000.00	3,002,376.00	0.50
TRFISGY81917	5,440,000.00	5,411,984.00	0.89
TRFISGY91924	6,330,000.00	6,161,495.40	1.02
TRFTEBK91970	10,000,000.00	9,790,800.00	1.62
TRFTHALK1913	9,800,000.00	9,853,900.00	1.63
TRFVFAS81920	5,000,000.00	4,930,100.00	0.81
TRFVFASE1912	4,860,000.00	4,675,368.60	0.77
TRFVKFB12029	1,330,000.00	1,221,711.40	0.20
TRFVKFB91973	10,000,000.00	9,759,500.00	1.61
TRFYKYM81919	6,000,000.00	5,976,840.00	0.99
TRFYKME1910	9,000,000.00	8,638,200.00	1.43
TOPLAM	238,560,000.00	233,324,322.00	38.55
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSARCL22117	3,000,000.00	3,212,370.00	0.53
TRSARCL72112	9,010,000.00	9,056,311.40	1.50
TRSAYGZE1914	2,600,000.00	2,701,920.00	0.45
TRSIGY32111	4,550,000.00	4,586,582.00	0.76
TRSKCTF32014	1,000,000.00	1,005,280.00	0.17
TRSKFTF42016	4,200,000.00	4,152,246.00	0.69
TRSOPAS22111	9,300,000.00	9,744,819.00	1.61
TRSOPAS42010	5,000,000.00	4,982,250.00	0.82
TRSOTKO32110	5,000,000.00	5,171,700.00	0.85
TRSOTKO81919	6,150,000.00	6,579,147.00	1.09
TRSRNSH22023	5,000,000.00	5,282,450.00	0.87
TRSTISB72712	5,000,000.00	5,277,650.00	0.87
TRSVKFB92719	5,000,000.00	5,135,150.00	0.85
TOPLAM	64,810,000.00	66,887,875.40	11.05
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
TRD120220T16	810,000.00	845,486.10	0.14
TRD181120T19	10,000.00	10,498.80	0.00
TRD220921T16	1,100,000.00	1,602,403.00	0.26
TRDHVKA81910	40,000.00	42,708.00	0.01
TRDKTLM22014	170,000.00	180,366.60	0.03
TRDVVRKE1947	790,000.00	801,747.30	0.13
TRDZKVK81911	80,000.00	84,503.20	0.01
TRDZKVK91910	130,000.00	133,974.10	0.02
TRDZKVK1916	120,000.00	122,017.20	0.02
TOPLAM	3,250,000.00	3,823,704.30	0.63

VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
TRT010420T19		20,706,794.00	49,525,712.88	8.18
TRT020823T11		1,977,945.00	3,501,821.92	0.58
TRT150120T16		379,398.00	370,162.60	0.06
TRT150120T16		13,842,889.00	13,507,012.60	2.23
TRT160425T17		3,868,665.00	5,502,863.01	0.91
TRT220921T18		26,810,435.00	24,012,493.15	3.97
TOPLAM		67,586,126.00	96,420,066.16	15.93
L) DİĞER	:			
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	:	605,287,532.86
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	11,522.52
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	1,064,133.76
FON TOPLAM DEĞERİ	:	604,234,921.62

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	1,011,141.66
37002 Denetim Ücreti	805.69
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	2,205.09
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	19,410.27
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	48.00
37006 Saklama Giderleri	18,370.97
37008 Banka Masrafları	1,335.60
37010 Kap Gideri	264.43
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	8,475.57
37028 Portföy Saklama Hizmeti	3,038.00
37030 E-fatura Gideri	118.00
37098 Küsürat farkları	22.49
37099 Diğer Giderler	146.94
Toplam	1,065,382.71

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

TRFGRFK71915

03.07.2019

5000000.00

TRFISMD71936

03.07.2019

4000000.00

TRDHVKA71911

03.07.2019

500000.00

TRFGRAN71910

04.07.2019

15000000.00

TRFAKFK71913

09.07.2019

7000000.00

TRDKTVK71931

09.07.2019

500000.00

TRT100719T18

10.07.2019

14400000.00

TRFYAKF71914

10.07.2019

10000000.00

TRFFNBK71915

12.07.2019

18000000.00

TRFISFA71928

12.07.2019

2500000.00

TRFISMD71944

17.07.2019

10000000.00

TRFGRFA71916

19.07.2019

1350000.00

TRFTEBK71931

19.07.2019

10000000.00

TRFAKYM71936

22.07.2019

10000000.00

TRFISFN71913

23.07.2019

15000000.00

TRFISFN71921

23.07.2019

6850000.00

TRFAKYM71951

24.07.2019

9000000.00

TRFFNBK71949

26.07.2019

3000000.00

TRDZKVK71920

26.07.2019

50000.00

TRFYAKF71922

30.07.2019

5000000.00

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