

YKP
(YHT) YAPI KREDİ PORTFOY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
EYLÜL 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	:	740,426,706.83
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	10,117,137,474.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	31.07.2002
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.073185
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.072075
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.54%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	16.15%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	23.05%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		32.09%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		51.77%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		0.75%
Kira Sertifikası-Kamu-YP		0.00%
Kira Sertifikası-Özel Sektör-TL		0.50%
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		12.32%
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		0.14%
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	2.43%
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	17.97%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	73.62%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	77.986
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	729,379,426.50
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	554,506,446.11

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRB091019T16	30,000,000.00	29,910,300.00	4.03
TRT050220T17	11,100,000.00	10,992,663.00	1.48
TRT080720T19	6,000,000.00	5,960,640.00	0.80
TRT100620T16	7,500,000.00	6,851,850.00	0.92
TRT111219T10	40,000,000.00	38,982,400.00	5.26
TRT120820T12	29,500,000.00	32,668,890.00	4.40
TRT130520T14	73,500,000.00	67,581,045.00	9.11
TRT131119T19	28,300,000.00	29,669,437.00	4.00
TRT150120T16	34,000,000.00	34,441,320.00	4.64
TRT160920T25	32,000,000.00	28,279,040.00	3.81
TOPLAM	291,900,000.00	285,337,585.00	38.47
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSİLİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFAKBKE1966	10,000,000.00	9,941,000.00	1.34
TRFDNFK12014	10,000,000.00	10,077,100.00	1.36
TRFDZBKE1925	7,000,000.00	6,990,060.00	0.94
TRFDZBKK1927	10,000,000.00	9,791,300.00	1.32

TRFFNBKE1919	10,000,000.00	9,984,400.00	1.35
TRFFNBKE1935	5,000,000.00	4,963,050.00	0.67
TRFFNBKK1945	15,000,000.00	14,656,350.00	1.98
TRFFNYME1928	5,000,000.00	4,930,650.00	0.66
TRFGRANA1916	30,000,000.00	30,300,900.00	4.08
TRFGRFAE1912	5,000,000.00	4,927,600.00	0.66
TRFGRFAK1914	9,590,000.00	9,378,252.80	1.26
TRFISFAK1911	10,720,000.00	10,515,248.00	1.42
TRFISFNE1914	3,120,000.00	3,114,384.00	0.42
TRFISFNK1932	4,310,000.00	4,215,783.40	0.57
TRFISGYA1914	9,110,000.00	8,880,792.40	1.20
TRFISGYK1912	7,300,000.00	7,170,279.00	0.97
TRFTCZB32018	7,900,000.00	7,994,563.00	1.08
TRFTCZB32026	9,520,000.00	9,567,028.80	1.29
TRFTCZB82013	8,870,000.00	9,024,781.50	1.22
TRFTHALK1913	9,800,000.00	10,020,108.00	1.35
TRFVFASE1912	4,860,000.00	4,856,986.80	0.65
TRFVKFB12029	1,330,000.00	1,261,411.90	0.17
TRFVKFB32019	4,580,000.00	4,642,517.00	0.63
TRFVKFBE1968	10,000,000.00	9,953,800.00	1.34
TRFVKFBK1945	5,000,000.00	4,898,250.00	0.66
TRFYKBK32013	25,000,000.00	25,211,000.00	3.40
TRFYKBKE1935	15,000,000.00	14,981,250.00	2.02
TRFYKYME1910	8,990,000.00	8,953,230.90	1.21
TRFYKYME1928	6,000,000.00	5,997,060.00	0.81
TOPLAM	268,000,000.00	267,199,137.50	36.02
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSARCL22117	3,000,000.00	3,066,300.00	0.41
TRSARCL72112	9,010,000.00	9,428,694.70	1.27
TRSAYGZE1914	2,600,000.00	2,763,540.00	0.37
TRISISGY32111	4,550,000.00	4,564,423.50	0.62
TRSKCTF32014	1,000,000.00	998,620.00	0.13
TRSKFTF42016	4,200,000.00	4,460,106.00	0.60
TRSOPAS22111	9,400,000.00	9,577,754.00	1.29
TRSOPAS42010	5,000,000.00	5,165,800.00	0.70
TRSOTKO32110	5,000,000.00	5,083,450.00	0.69
TRSOTKO72116	9,500,000.00	9,804,095.00	1.32
TRSRNSH22023	5,000,000.00	5,102,050.00	0.69
TRSTISB72712	5,000,000.00	5,141,250.00	0.69
TRSVKFB92719	5,000,000.00	4,993,650.00	0.67
TOPLAM	68,260,000.00	70,149,733.20	9.46
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
TRD100221T17	140,000.00	150,655.40	0.02
TRD120220T16	1,190,000.00	1,213,478.70	0.16
TRD160621T17	230,000.00	271,657.60	0.04
TRDKTVKE1955	80,000.00	81,967.20	0.01
TRDKTVKE1963	110,000.00	111,964.60	0.02

TRDVVRKK1915	1,250,000.00	1,258,387.50	0.17
TRDZKVKA1910	340,000.00	346,494.00	0.05
TOPLAM	3,340,000.00	3,434,605.00	0.46
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TRT110320T18	17,281,770.00	18,008,028.49	2.43
TRT150120T16	133,355.00	135,049.97	0.02
TRT150120T16	12,347,631.00	12,505,575.33	1.69
TRT170822T15	43,643,830.00	40,017,873.98	5.39
TRT200422T14	42,880,415.00	45,020,108.23	6.07
TOPLAM	116,287,001.00	115,686,636.00	15.60
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	:	741,807,696.70
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	17,117.86
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	1,398,107.73
FON TOPLAM DEĞERİ	:	740,426,706.83

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	1,270,843.00
37002 Denetim Ücreti	753.71
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	3,460.04
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	23,968.05
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	135.94
37006 Saklama Giderleri	18,678.53
37008 Banka Masrafları	658.48
37010 Kap Gideri	247.37
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	672.00
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	16,468.86
37028 Portföy Saklama Hizmeti	3,958.50
37030 E-fatura Gideri	118.00
37098 Küsürat farkları	0.02
37099 Diğer Giderler	137.46
Toplam	1,340,099.96

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
TRFAKBK919B4	04.09.2019	9990000.00
TRFAKFK91945	06.09.2019	10000000.00
TRFFNBK91913	06.09.2019	14990000.00
TRFTEBK91970	06.09.2019	9990000.00
TRFAKFK91937	13.09.2019	8490000.00
TRFGRAN91959	13.09.2019	10000000.00
TRFISMD91991	13.09.2019	10000000.00
TRFVKFB91973	13.09.2019	10000000.00
TRT180919T18	18.09.2019	15000000.00
TRFAKBK919S8	18.09.2019	15000000.00
TRFFNBK91970	20.09.2019	14390000.00
TRFISGY91924	20.09.2019	6330000.00
TRFTCZB91931	20.09.2019	10000000.00

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
------------------------	---------------	---------	-------------	--------------------