

YKP
(YBS) YAPI KREDİ PORTFOY ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
EKİM 2019 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	(YBS) YAPI KREDİ PORTFOY ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFOY YÖNETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	600,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	543,252,362.49
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	23,394,737,423.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	25.01.2012
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.023221
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.022939
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.23%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	17.56%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	22.40%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		1.76%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		84.21%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		0.84%
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%
Eurobond Repo		0.00%
Devlet Tahvili Ters Repo		11.63%
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		0.19%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.00%

Yabancı Hisse Senetleri	0.00%
VIOP Nakit Teminat	0.37%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	0.02%
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%
CD Swap	0.00%
VDMK	0.99%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	22.87%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	41.52%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	85.852
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	57,055,566.06
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	27,887,350.93

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			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFAKBK12023	15,000,000.00	14,646,750.00	2.67
TRFAKYMA1920	5,000,000.00	4,910,950.00	0.89
TRFDFKT22010	3,000,000.00	2,835,390.00	0.52
TRFDGOZ71915	1,433,429.00	1,433,429.00	0.26
TRFDZBK32023	10,000,000.00	10,233,800.00	1.86
TRFDZBKK1927	10,000,000.00	9,915,200.00	1.81
TRFFNBK12034	7,500,000.00	7,291,050.00	1.33
TRFFNBKA1954	10,000,000.00	9,807,800.00	1.79
TRFFNBKK1945	15,000,000.00	14,877,600.00	2.71
TRFGRANA1916	15,000,000.00	15,142,650.00	2.76
TRFGRFAK1914	15,700,000.00	15,596,694.00	2.84
TRFHLFK12019	15,000,000.00	14,577,000.00	2.66
TRFISFAK1911	10,000,000.00	9,964,500.00	1.82
TRFISGY12011	4,540,000.00	4,422,595.60	0.81

TRFISGYA1914	9,110,000.00	8,991,114.50	1.64
TRFISGYK1912	3,640,000.00	3,627,988.00	0.66
TRFISGYK1920	9,000,000.00	8,958,870.00	1.63
TRFISMD12047	14,070,000.00	13,725,285.00	2.50
TRFISMDA1952	10,000,000.00	9,816,200.00	1.79
TRFTCZB32018	19,780,000.00	20,289,730.60	3.70
TRFTCZB32026	3,170,000.00	3,228,835.20	0.59
TRFTCZB82013	8,870,000.00	9,159,339.40	1.67
TRFTEBKK1932	15,000,000.00	15,000,000.00	2.73
TRFTHAL22010	7,000,000.00	7,080,080.00	1.29
TRFTHALK1913	7,000,000.00	7,137,970.00	1.30
TRFVFASK1914	5,230,000.00	5,205,994.30	0.95
TRFVKFBK1945	20,000,000.00	19,872,400.00	3.62
TRFYKBBK32013	10,000,000.00	10,067,200.00	1.83
TRFYKMK1938	5,000,000.00	4,964,000.00	0.90
TOPLAM	284,043,429.00	282,780,415.60	51.51
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSAKFKK1910	200,000.00	305,834.00	0.06
TRSAKYP41612	3,253,744.00	3,421,018.98	0.62
TR SARCL22117	5,000,000.00	5,185,450.00	0.94
TR SAYGZ12024	4,890,000.00	5,015,477.40	0.91
TR SAYGZ62110	2,100,000.00	2,139,081.00	0.39
TRSBOLU72119	2,500,000.00	2,491,925.00	0.45
TRSCMSA32112	3,190,000.00	3,259,350.60	0.59
TR SENSE72211	5,000,000.00	6,752,900.00	1.23
TRSERGL52117	3,500,000.00	3,660,615.00	0.67
TR SISGY32111	3,640,000.00	3,702,571.60	0.67
TRSKALE62114	5,000,000.00	5,040,350.00	0.92
TRSKCTF32014	2,000,000.00	2,024,240.00	0.37
TRSKCTY32015	3,410,000.00	3,506,468.90	0.64
TRSKCTY62012	4,000,000.00	4,205,520.00	0.77
TRSKFTF42016	4,800,000.00	5,166,288.00	0.94
TRSKFTF62113	4,000,000.00	4,095,160.00	0.75
TRSKRSNE2018	200,000.00	201,716.00	0.04
TRSOPAS22111	10,900,000.00	11,266,785.00	2.05
TRSOPAS42010	7,000,000.00	6,814,220.00	1.24
TRSORFN72013	3,490,000.00	3,470,211.70	0.63
TR SOTKO12013	5,000,000.00	5,265,950.00	0.96
TR SOTKO32110	5,000,000.00	5,153,350.00	0.94
TRSRNSH22023	5,000,000.00	5,120,900.00	0.93
TRSSRTN72114	2,500,000.00	2,489,650.00	0.45
TRSTBTF32116	10,000,000.00	10,153,300.00	1.85
TRSTHALE2716	3,200,000.00	3,222,080.00	0.59
TRSTISB72712	11,000,000.00	11,484,880.00	2.09
TRSTISB92918	8,000,000.00	8,135,040.00	1.48
TRSTPRS12115	1,000,000.00	1,003,970.00	0.18
TRSTTRK42012	2,740,000.00	2,799,430.60	0.51
TRSVKFB92719	3,000,000.00	3,069,030.00	0.56

TRSYDAT22015	10,000,000.00	10,192,000.00	1.86
TRSYKKBK62914	4,500,000.00	4,560,165.00	0.83
TRSYKKBK92911	10,000,000.00	10,135,500.00	1.85
TOPLAM	159,013,744.00	164,510,428.78	29.97
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
TRD220921T16	3,000,000.00	4,487,340.00	0.82
TOPLAM	3,000,000.00	4,487,340.00	0.82
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TRT050220T17	513,575.00	500,200.00	0.09
TRT050624T35	1,916,715.00	2,000,800.00	0.36
TRT060121T16	3,995,230.00	9,003,600.00	1.64
TRT110226T13	21,807,150.00	19,507,800.00	3.55
TRT110320T18	10,723,655.00	11,004,400.00	2.00
TRT120820T12	2,749,160.00	3,001,200.00	0.55
TRT131119T19	20,431,020.00	21,008,400.00	3.83
TRT150120T16	185,173.00	190,048.62	0.03
TRT210721T11	8,748,180.00	19,007,600.00	3.46
TOPLAM	71,069,858.00	85,224,048.62	15.52
L) DİĞER	:		
BPP	4,690,721.44	4,690,721.44	0.85
TOPLAM		4,690,721.44	0.85
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		
	1,962,636.34	1,962,636.34	0.36
TOPLAM	1,962,636.34	1,962,636.34	0.36
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
O) VDMK	:		
TRPTYV232410	5,000,000.00	5,301,200.00	0.97
TOPLAM	5,000,000.00	5,301,200.00	0.97
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU	:		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	548,956,790.78	
B. HAZİR DEĞERLER (+)	:	10,269.57	
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00	
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00	
E. BORÇLAR (-)	:	860,249.89	
FON TOPLAM DEĞERİ	:	543,252,362.49	
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	:		
Açıklama		Tutarı	
37001 Fon Yönetim Ücreti		818,547.90	

37002	Denetim Ücreti	221.65
370031	SGMK Tahvil Borsa Payı	1,558.95
370032	O/N RRP Tahvil Borsa Payı	16,071.10
37005	Vergi, Resim ve Harçlar	148.33
37006	Saklama Giderleri	15,093.37
37008	Banka Masrafları	1,516.48
37015	Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	730.32
37021	Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	9,101.17
37028	Portföy Saklama Hizmeti	5,288.50
37030	E-fatura Gideri	354.00
Toplam		868,631.77

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	İtf Tarihi	Nominal
TRFHLFKE1915	02.10.2019	10000000.00
TRFVFASE1912	02.10.2019	4860000.00
TRSTIMGE1918	02.10.2019	2000000.00
XS1891679547	02.10.2019	6000000.00
TRFDZBKE1925	04.10.2019	3000000.00
TRFISFNE1914	04.10.2019	3120000.00
TRSRNSHE1916	08.10.2019	500000.00
TRSIGYE1915	10.10.2019	2760000.00
TRSSRTNE1912	11.10.2019	3000000.00
TRFAKBKE1966	14.10.2019	20000000.00
TRSKRSNE1911	15.10.2019	5700000.00
TRFFNBKE1935	18.10.2019	2500000.00
TRFISMDE1925	21.10.2019	15000000.00
TRFDZBKE1958	25.10.2019	15000000.00
TRFFFKRE1929	30.10.2019	10000000.00
TRFFNYME1928	31.10.2019	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
------------------------	---------------	---------	-------------	--------------------