

YKP
(YHT) YAPI KREDİ PORTFOY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
EKİM 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	:	653,059,932.08
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	8,821,525,558.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	31.07.2002
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.074030
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.073185
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.15%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	17.49%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	22.13%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		40.32%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		46.31%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		1.09%
Kira Sertifikası-Kamu-YP		0.00%
Kira Sertifikası-Özel Sektör-TL		0.36%
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		11.91%
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	0.01%
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	0.00%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 18.69%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	119.43%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 85.370
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 794,227,588.53
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	: 889,399,967.93

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRB220120T17	69,500,000.00	67,679,795.00	10.36
TRT050220T17	1,100,000.00	1,105,654.00	0.17
TRT100620T16	20,500,000.00	19,103,745.00	2.93
TRT111219T10	6,000,000.00	5,918,700.00	0.91
TRT120820T12	8,000,000.00	9,025,200.00	1.38
TRT130520T14	71,000,000.00	66,772,660.00	10.23
TRT131119T19	65,300,000.00	69,255,221.00	10.61
TRT150120T16	32,500,000.00	33,376,200.00	5.11
TRT150120T32	17,000,000.00	16,580,950.00	2.54
TOPLAM	290,900,000.00	288,818,125.00	44.23
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
TRT131119T19	-15,000,000.00	-15,908,550.00	-2.44
TRT150120T16	14,000,000.00	14,379,680.00	2.20
TOPLAM	-1,000,000.00	-1,528,870.00	-0.23
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ,(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFAKBK12023	20,000,000.00	19,529,000.00	2.99

TRFDNFK12014	10,000,000.00	10,073,100.00	1.54
TRFDZBKK1927	10,000,000.00	9,915,200.00	1.52
TRFFNBKA19A3	10,000,000.00	9,843,600.00	1.51
TRFFNYM12016	10,000,000.00	9,744,200.00	1.49
TRFGRANA1916	30,000,000.00	30,285,300.00	4.64
TRFGRFAK1914	590,000.00	586,117.80	0.09
TRFISFAK1911	720,000.00	717,444.00	0.11
TRFISFN12016	10,000,000.00	9,730,600.00	1.49
TRFISFNK1932	4,310,000.00	4,275,132.10	0.65
TRFISGYA1914	9,110,000.00	8,991,114.50	1.38
TRFISGYK1912	7,300,000.00	7,275,910.00	1.11
TRFTCZB32018	7,900,000.00	8,103,583.00	1.24
TRFTCZB32026	9,520,000.00	9,696,691.20	1.48
TRFTCZB82013	8,870,000.00	9,159,339.40	1.40
TRFTHALK1913	9,800,000.00	9,993,158.00	1.53
TRFVKFB12029	1,330,000.00	1,282,080.10	0.20
TRFVKFB32019	4,580,000.00	4,705,537.80	0.72
TRFYKBK32013	25,000,000.00	25,168,000.00	3.85
TRFYKYMA1922	9,000,000.00	8,867,610.00	1.36
TRFYKYMK1946	10,000,000.00	9,901,800.00	1.52
TOPLAM	208,030,000.00	207,844,517.90	31.83
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSARCL22117	3,000,000.00	3,111,270.00	0.48
TRSARCL72112	9,010,000.00	9,133,977.60	1.40
TRISISGY32111	4,550,000.00	4,628,214.50	0.71
TRSKCTF32014	1,000,000.00	1,012,120.00	0.15
TRSKFTF42016	4,200,000.00	4,520,502.00	0.69
TRSOPAS22111	9,400,000.00	9,716,310.00	1.49
TRSOPAS42010	5,000,000.00	4,867,300.00	0.75
TRSOTKO32110	5,000,000.00	5,153,350.00	0.79
TRSOTKO72116	9,500,000.00	9,963,790.00	1.53
TRSRNSH22023	5,000,000.00	5,120,900.00	0.78
TRSTISB72712	5,000,000.00	5,220,400.00	0.80
TRSVKFB92719	5,000,000.00	5,115,050.00	0.78
TOPLAM	65,660,000.00	67,563,184.10	10.35
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
TRD100221T17	140,000.00	155,645.00	0.02
TRD120220T16	1,240,000.00	1,279,754.40	0.20
TRD160621T17	80,000.00	96,445.60	0.01
TRD180821T13	2,010,000.00	2,166,699.60	0.33
TRD230920T24	650,000.00	737,405.50	0.11
TRDVVRKK1915	240,000.00	244,144.80	0.04
TRDVVRKK1923	160,000.00	161,747.20	0.02
TRDZKVK1910	340,000.00	350,907.20	0.05
TOPLAM	4,860,000.00	5,192,749.30	0.80
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		

İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
TRT010420T19		27,437,542.00	67,027,020.28	10.26
TRT150120T16		73,095.00	75,019.19	0.01
TRT150120T16		7,796,740.00	8,003,226.32	1.23
TRT210721T11		4,604,305.00	10,004,000.00	1.53
TOPLAM		39,911,682.00	85,109,265.79	13.03
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	:	652,998,972.09
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	9,066.22
C. ALACAKLAR (+)	:	15,910,714.29
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	15,858,820.52
FON TOPLAM DEĞERİ	:	653,059,932.08

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	1,413,958.65
37002 Denetim Ücreti	805.69
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	9,112.57
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	24,713.21
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	128.94
37006 Saklama Giderleri	16,808.69
37008 Banka Masrafları	983.51
37010 Kap Gideri	264.43
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	6.45
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	11,856.15
37028 Portföy Saklama Hizmeti	4,206.30
37030 E-fatura Gideri	354.00
37098 Küsürat farkları	25.68
37099 Diğer Giderler	146.94
Toplam	1,483,371.21

6- GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI, BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI, TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLİNE İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

Açıklama	Giriş Tarihi	Stok	Kazanılan Nominal
----------	--------------	------	-------------------

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR

:

8- İTFALAR

:

Menkul Kıymet Türü

İtfat Tarihi

Nominal

TRFVFASE1912

02.10.2019

4860000.00

TRFYKYME1928

02.10.2019

6000000.00

TRFDZBKE1925

04.10.2019

7000000.00

TRFFNBKE1919

04.10.2019

10000000.00

TRFISFNE1914

04.10.2019

3120000.00

TRFYKBKE1935

04.10.2019

15000000.00

TRB091019T16

09.10.2019

30000000.00

TRFYKYME1910

09.10.2019

8990000.00

TRDKTVKE1955

09.10.2019

80000.00

TRFVKFBE1968

11.10.2019

10000000.00

TRFAKBKE1966

14.10.2019

10000000.00

TRFFNBKE1935

18.10.2019

5000000.00

TRSAYGZE1914

18.10.2019

2600000.00

TRFGRFAE1912

24.10.2019

5000000.00

TRDZKVKE1924

25.10.2019

2000000.00

TRFFNYME1928

31.10.2019

5000000.00

TRDKTVKE1963

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