

YKP**(YBE) YAPI KREDİ PORTFOY EUROBOND (DOLAR) BORCLANMA ARAÇLARI FONU****OCAK 2020 AYLIK RAPORUDUR.****1- FONU TANITICI BİLGİLER**

A. FONUN ADI	:	(YBE) YAPI KREDİ PORTFOY EUROBOND (DOLAR) BORCLANMA ARAÇLARI FONU
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	1,000,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	2,106,376,675.29
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	11,707,095,033.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	29.06.2000
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.179923
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.171581
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	4.86%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	4.86%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	30.13%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		9.26%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		2.08%
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%
Eurobond Repo		0.00%
Devlet Tahvili Ters Repo		2.99%
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		0.20%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		82.89%

Yabancı Hisse Senetleri	0.00%
VIOP Nakit Teminat	0.96%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	0.00%
Vadeli_YP	1.20%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	0.31%
Katılma Belgesi YP	0.00%
Katılım Hesabı	0.00%
CC Swap	0.00%
FX Swap	0.04%
IR Swap	0.00%
CD Swap	0.00%
VDMK	0.06%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	21.83%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	6.04%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	2303.171
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	301,666,080.71
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	33,832,379.72

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			
TRT150121F11	16,890,000.00	112,951,895.94	5.37
TRT171221F16	8,200,000.00	54,240,176.38	2.58
TOPLAM	25,090,000.00	167,192,072.32	7.95
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFDGOZ71915	1,337,868.00	1,337,868.00	0.06
TOPLAM	1,337,868.00	1,337,868.00	0.06
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ			
TRSKCTF32014	5,000,000.00	5,270,900.00	0.25
TRSKFTF42016	4,800,000.00	5,043,696.00	0.24
TRSKRSNE2018	400,000.00	402,664.00	0.02
TRSOPAS22012	2,000,000.00	2,133,980.00	0.10
TRSOPAS42010	8,000,000.00	8,417,040.00	0.40
TRSOTKO22012	5,000,000.00	5,322,400.00	0.25

TRSRNSH22023	2,000,000.00	2,061,780.00	0.10
TRSYKBK62914	4,500,000.00	4,501,305.00	0.21
TOPLAM	31,700,000.00	33,153,765.00	1.58
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
İ) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
US900123AT75	10310000.00	77380449.25	3.68
US900123AW05	7120000.00	49473270.00	2.35
US900123AY60	23750000.00	161306711.62	7.67
US900123BB58	10051000.00	70928258.04	3.37
US900123BG46	11250000.00	74137361.20	3.53
US900123BJ84	4485000.00	27129852.09	1.29
US900123BZ27	3598000.00	23435925.99	1.11
US900123CF53	19270000.00	124463943.72	5.92
US900123CG37	19900000.00	131043293.59	6.23
US900123CK49	1000000.00	6079061.60	0.29
US900123CL22	16900000.00	108985146.91	5.18
US900123CM05	7466000.00	43633830.61	2.08
US900123CP36	4000000.00	24536157.51	1.17
US900123CQ19	23000000.00	148227508.99	7.05
US900123CR91	10000000.00	66989577.49	3.19
US900123CT57	9000000.00	63594841.24	3.02
US900123CW86	13900000.00	88494252.28	4.21
XS0847042024	6553000.00	40717488.48	1.94
XS0849728190	5454000.00	33930313.60	1.61
XS0861979440	400000.00	2445982.77	0.12
XS1003016018	115000.00	751144.93	0.04
XS1175854923	6050000.00	37376344.16	1.78
XS1376681067	163000.00	1042630.36	0.05
XS1578203462	6770000.00	42702877.56	2.03
XS1584113184	141000.00	882125.46	0.04
XS1622626379	695000.00	4319963.21	0.21
XS1684378208	11834000.00	72565130.69	3.45
XS1711581337	1400000.00	8454788.67	0.40
XS1750996206	9690000.00	59584106.55	2.83
XS1788516679	5200000.00	33163375.14	1.58
XS1917720911	300000.00	2005566.23	0.10
XS1958649854	2000000.00	13757227.11	0.65
XS1961766596	4100000.00	27261254.81	1.30
XS1970705528	1000000.00	6814378.24	0.32
XS2100270508	200000.00	1224741.36	0.06
XS2106022754	3700000.00	22551752.20	1.07
TOPLAM	260,765,000.00	1,701,390,633.67	80.92
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TRT020322T17	56,683,500.00	58,551,784.53	2.78
TRT080328T15	10,473,605.00	12,010,602.74	0.57

TRT111120T18	19,326,585.00	20,017,687.67	0.95
TRT240227T17	938,725.00	1,000,883.56	0.05
TRT240227T17	1,408,095.00	1,501,327.80	0.07
TOPLAM	88,830,510.00	93,082,286.30	4.43
L) DİĞER	:		
Forward EURO/USD	-7,000,000.00		
FX Swap YBE-0411/0402	10,000,000.00	1,042,906.25	0.05
FX Swap YBE-2012/2102	10,000,000.00	575,056.67	0.03
YPL	325,000.00	2,150,935.13	0.10
Vadeli Mevduat YP gün 12	9,500,000.00	56,749,001.67	2.70
F_USDTRY0220	-36,800.00	-221,304,160.00	
BPP	37,032.84	37,032.84	0.00
TOPLAM		60,554,932.57	2.88
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		
	44,617,685.83	44,617,685.83	2.12
TOPLAM	44,617,685.83	44,617,685.83	2.12
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
O) VDMK	:		
TRPTYV232410	1,000,000.00	1,171,350.00	0.06
TOPLAM	1,000,000.00	1,171,350.00	0.06
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU	:		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	2,102,500,593.69	
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	8,190.29	
C. ALACAKLAR (+)	:	12,602,765.16	
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00	
E. BORÇLAR (-)	:	7,397,005.85	
FON TOPLAM DEĞERİ	:	2,106,376,675.29	
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	:		
Açıklama		Tutarı	
37001 Fon Yönetim Ücreti		5,191,149.80	
37002 Denetim Ücreti		858.00	
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı		15,909.60	
370034 Yabancı Menkul Komisyonu		3,624.19	
37005 Vergi, Resim ve Harçlar		508,753.25	
37006 Saklama Giderleri		23,514.02	
37008 Banka Masrafları		272.99	
37009 Noter Tasdik ve Ücreti		106.54	
37010 Kap Gideri		281.49	
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu		3,056.45	
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti		35,089.28	
37023 VIOP İşlemi Komisyonu		18,626.27	
37028 Portföy Saklama Hizmeti		5,152.00	
37030 E-fatura Gideri		118.00	

37098	Küsürat farkları	0.08
37099	Diğer Giderler	156.42
Toplam		5,806,668.38

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
TRSAYGZ12024	24.01.2020	3500000.00
TRSOTKO12013	31.01.2020	3050000.00

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