

YKP
(YBS) YAPI KREDİ PORTFOY ÖZEL SEKTÖR BORCLANMA ARAÇLARI FONU
OCAK 2020 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	(YBS) YAPI KREDİ PORTFOY ÖZEL SEKTÖR BORCLANMA ARAÇLARI FONU
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFOY YONETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	600,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	822,603,057.75
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	34,325,393,218.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	25.01.2012
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.023965
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.023728
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.00%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	1.00%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	19.44%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		0.23%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		85.50%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		1.48%
Kira Sertifikası-Kamu-YP		0.00%
Kira Sertifikası-Özel Sektör-TL		0.27%
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		11.39%
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		0.03%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.00%

Yabancı Hisse Senetleri	0.00%
VIOP Nakit Teminat	0.27%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	0.09%
Vadeli_YP	0.00%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	0.00%
Katılma Belgesi YP	0.00%
Katılım Hesabı	0.00%
CC Swap	0.00%
FX Swap	0.00%
IR Swap	0.00%
CD Swap	0.00%
VDMK	0.74%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 31.20%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	55.22%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 76.236
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 219,408,449.67
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	: 74,062,618.34

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT260122T11	10,000,000.00	10,073,700.00	1.22
TOPLAM	10,000,000.00	10,073,700.00	1.22
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFAKBK22022	15,000,000.00	14,924,250.00	1.80
TRFAKBK22055	10,000,000.00	9,954,800.00	1.20
TRFAKBK32021	25,000,000.00	24,797,000.00	2.99
TRFALNF22017	5,000,000.00	4,998,300.00	0.60
TRFDFTK22010	3,000,000.00	2,986,800.00	0.36
TRFDGOZ71915	1,433,429.00	1,433,429.00	0.17
TRFDNFK42011	30,000,000.00	29,432,400.00	3.55
TRFDZBK32023	10,000,000.00	10,183,500.00	1.23
TRFDZBK42022	30,000,000.00	29,368,800.00	3.54
TRFEGYO62014	10,000,000.00	9,660,900.00	1.17
TRFFNBK22025	15,000,000.00	14,950,050.00	1.80

TRFFNBK32032	10,000,000.00	9,871,500.00	1.19
TRFFNBK42015	7,500,000.00	7,368,975.00	0.89
TRFFNBK42031	30,000,000.00	29,421,900.00	3.55
TRFFNBK52014	5,000,000.00	4,878,150.00	0.59
TRFFNYM32014	5,000,000.00	4,941,900.00	0.60
TRFFNYM42013	10,000,000.00	9,817,100.00	1.18
TRFGRAN32011	33,400,000.00	33,598,396.00	4.05
TRFGRAN32037	5,000,000.00	4,934,150.00	0.60
TRFGRAN42010	2,900,000.00	2,916,965.00	0.35
TRFHLFK52015	15,000,000.00	14,600,700.00	1.76
TRFISFN52012	14,630,000.00	14,166,521.60	1.71
TRFISFN52020	20,000,000.00	19,348,000.00	2.33
TRFISGY52017	11,500,000.00	11,101,525.00	1.34
TRFISMD32052	5,000,000.00	4,945,150.00	0.60
TRFISMD42051	10,000,000.00	9,821,600.00	1.19
TRFISMD42077	5,000,000.00	4,910,750.00	0.59
TRFOYMD22018	1,000,000.00	1,000,000.00	0.12
TRFOYMD32017	8,000,000.00	7,881,440.00	0.95
TRFTCZB32018	19,780,000.00	20,213,973.20	2.44
TRFTCZB32026	3,170,000.00	3,230,230.00	0.39
TRFTCZB82013	8,870,000.00	9,102,305.30	1.10
TRFTHAL22010	7,000,000.00	7,019,740.00	0.85
TRFTISB52018	37,930,000.00	36,878,959.70	4.45
TRFVFAS32014	15,000,000.00	14,809,050.00	1.79
TRFVFAS42013	10,000,000.00	9,831,300.00	1.19
TRFVKFB22010	45,000,000.00	44,740,800.00	5.40
TRFVKFB52033	10,000,000.00	9,754,000.00	1.18
TRFYAKF32015	10,000,000.00	9,917,000.00	1.20
TRFYKBK32013	10,000,000.00	10,023,500.00	1.21
TRFYKYM22012	5,000,000.00	4,975,200.00	0.60
TRFYKYM22020	3,000,000.00	2,987,250.00	0.36
TRFYKYM42036	7,000,000.00	6,868,050.00	0.83
TOPLAM	545,113,429.00	538,566,309.80	64.99
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSAKYP41612	3,253,744.00	3,421,018.98	0.41
TR SARCL22117	5,000,000.00	5,201,250.00	0.63
TR SAYGZ62110	2,100,000.00	2,115,414.00	0.26
TRSBOLU72119	2,500,000.00	2,456,525.00	0.30
TRSCMSA32112	3,190,000.00	3,246,239.70	0.39
TR SENSEA72211	5,000,000.00	7,049,950.00	0.85
TRSERGL52117	3,500,000.00	3,617,425.00	0.44
TR SISGY32111	3,640,000.00	3,693,580.80	0.45
TRSKALE62114	5,000,000.00	4,979,300.00	0.60
TRSKCTF32014	2,000,000.00	2,108,360.00	0.25
TRSKCTY32015	3,410,000.00	3,482,155.60	0.42
TRSKCTY62012	4,000,000.00	4,076,080.00	0.49
TRSKFTF42016	4,700,000.00	4,938,619.00	0.60
TRSKFTF62113	4,000,000.00	4,097,600.00	0.49

TRSKRSNE2018	200,000.00	201,332.00	0.02
TRSOPAS22111	10,900,000.00	11,152,771.00	1.35
TRSOPAS42010	7,000,000.00	7,364,910.00	0.89
TRSORFN72013	3,490,000.00	3,481,763.60	0.42
TRSOTKO32110	5,000,000.00	5,094,500.00	0.61
TRSRNSH22023	5,000,000.00	5,154,450.00	0.62
TRSSRTN72114	2,500,000.00	2,457,725.00	0.30
TRSTBTF32116	10,000,000.00	10,036,800.00	1.21
TRSTHALE2716	3,200,000.00	3,202,080.00	0.39
TRSTISB72712	11,000,000.00	11,401,280.00	1.38
TRSTISB92918	8,000,000.00	8,091,600.00	0.98
TRSTPRS12115	1,000,000.00	1,002,990.00	0.12
TRSTTRK42012	2,740,000.00	2,773,921.20	0.33
TRSVKFB92719	3,000,000.00	3,242,580.00	0.39
TRSYDAT22015	10,000,000.00	10,351,300.00	1.25
TRSYKBK62914	4,500,000.00	4,501,305.00	0.54
TRSYKBK92911	10,000,000.00	10,043,700.00	1.21
TOPLAM	148,823,744.00	154,038,525.88	18.59
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
TRD120220T16	19,330,000.00	20,511,449.60	2.48
TRD220921T16	3,000,000.00	4,746,420.00	0.57
TRD260122T19	20,000,000.00	20,161,200.00	2.43
TRDVVRK42024	670,000.00	673,162.40	0.08
TRDZKVK52011	5,000,000.00	5,006,300.00	0.60
TOPLAM	48,000,000.00	51,098,532.00	6.17
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TRT100124T17	10,770,405.00	12,010,612.60	1.45
TRT100124T17	9,872,880.00	11,009,737.26	1.33
TRT170822T15	18,405,570.00	19,016,818.90	2.29
TRT201021T25	8,459,770.00	9,007,959.45	1.09
TRT240227T17	938,725.00	1,000,885.21	0.12
TOPLAM	48,447,350.00	52,046,013.42	6.28
L) DİĞER	:		
Vadeli Mevduat gün 94	15,000,000.00	15,011,844.73	1.81
BPP	22,018.53	22,018.53	0.00
TOPLAM		15,033,863.26	1.81
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		
	2,018,806.36	2,018,806.36	0.24
TOPLAM	2,018,806.36	2,018,806.36	0.24
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
O) VDMK	:		
TRPTYV232410	5,000,000.00	5,856,750.00	0.71

TOPLAM	5,000,000.00	5,856,750.00	0.71
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU :

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	828,732,500.72
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	3,942.86
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	1,278,937.86
FON TOPLAM DEĞERİ	:	822,603,057.75

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER :

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	1,229,770.92
37002 Denetim Ücreti	235.95
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	1,871.74
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	22,268.40
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	58.80
37006 Saklama Giderleri	22,169.97
37008 Banka Masrafları	1,022.87
37009 Noter Tasdik ve Ücreti	106.54
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	176.35
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	13,672.14
37028 Portföy Saklama Hizmeti	5,152.00
37030 E-fatura Gideri	118.00
Toplam	1,296,623.68

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 Tarih	Nominal
TRFAKBK12023	03.01.2020	35000000.00
TRFDNFK12014	10.01.2020	20000000.00
TRFISGY12011	10.01.2020	4540000.00
TRFISMD12047	10.01.2020	14070000.00
TRFOYMD12019	10.01.2020	4000000.00
TRFHFLFK12019	15.01.2020	15000000.00
TRDKTVK12034	15.01.2020	4000000.00
TRDKTVK12018	15.01.2020	8300000.00
TRFFNBK12034	17.01.2020	7500000.00
TRFDZBK12058	24.01.2020	10000000.00
TRFFNBK12042	24.01.2020	20000000.00

TRSAYGZ12024	24.01.2020	4890000.00
TRFYKYM12021	29.01.2020	5000000.00
TRSOTKO12013	31.01.2020	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
------------------------	---	---------------	---------	-------------	--------------------