

YKP
(YHT) YAPI KREDİ PORTFOY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
OCAK 2020 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	:	756,524,213.96
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	9,934,202,433.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	31.07.2002
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.076153
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.075479
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	0.89%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	0.89%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	18.83%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		37.15%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		50.34%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		1.86%
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		10.59%
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	0.06%
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	0.00%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 20.33%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	58.19%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 80.084
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 779,683,012.75
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	: 753,913,241.15

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRB220420T14	41,000,000.00	40,173,030.00	5.30
TRT050220T17	100,000.00	103,637.00	0.01
TRT071020T23	30,500,000.00	28,559,590.00	3.77
TRT080720T19	29,000,000.00	29,139,200.00	3.84
TRT100620T16	60,500,000.00	58,493,820.00	7.71
TRT120820T12	3,000,000.00	3,527,160.00	0.47
TRT130520T14	76,000,000.00	74,015,640.00	9.76
TRT160920T25	50,000,000.00	47,079,000.00	6.21
TOPLAM	290,100,000.00	281,091,077.00	37.07
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSİLİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFAKBK22022	20,000,000.00	19,899,000.00	2.62
TRFAKBK22055	10,000,000.00	9,954,800.00	1.31
TRFDNFK42011	20,000,000.00	19,621,600.00	2.59
TRFFNBK22017	15,000,000.00	14,982,150.00	1.98

TRFFNBK22074	10,000,000.00	9,924,500.00	1.31
TRFFNBK32024	10,000,000.00	9,905,200.00	1.31
TRFFNBK52014	5,000,000.00	4,878,150.00	0.64
TRFFNYM42013	10,000,000.00	9,817,100.00	1.29
TRFGRAN32011	18,800,000.00	18,911,672.00	2.49
TRFGRAN42010	11,600,000.00	11,667,860.00	1.54
TRFISFN72010	15,550,000.00	14,866,577.50	1.96
TRFISGY52017	2,860,000.00	2,760,901.00	0.36
TRFISMD32045	10,000,000.00	9,906,600.00	1.31
TRFISMD42051	10,000,000.00	9,821,600.00	1.30
TRFISMD42077	15,000,000.00	14,732,250.00	1.94
TRFTCZB32018	7,900,000.00	8,073,326.00	1.06
TRFTCZB32026	9,520,000.00	9,700,880.00	1.28
TRFTCZB82013	8,870,000.00	9,102,305.30	1.20
TRFTISB52018	28,450,000.00	27,661,650.50	3.65
TRFVFAS32014	15,000,000.00	14,809,050.00	1.95
TRFVFAS42013	10,000,000.00	9,831,300.00	1.30
TRFVKFB22010	10,000,000.00	9,942,400.00	1.31
TRFVKFB32019	4,580,000.00	4,666,699.40	0.62
TRFYAKF32023	10,000,000.00	9,901,400.00	1.31
TRFYKBK32013	25,000,000.00	25,058,750.00	3.30
TRFYKYM22046	5,000,000.00	4,996,900.00	0.66
TRFYKYM22053	8,500,000.00	8,477,135.00	1.12
TOPLAM	326,630,000.00	323,871,756.70	42.71
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSARCL22117	3,000,000.00	3,120,750.00	0.41
TRSARCL72112	9,010,000.00	8,995,854.30	1.19
TRISISGY32111	4,550,000.00	4,616,976.00	0.61
TRSKCTF32014	1,000,000.00	1,054,180.00	0.14
TRSKFTF42016	4,200,000.00	4,413,234.00	0.58
TRSOPAS22111	9,400,000.00	9,617,986.00	1.27
TRSOPAS42010	5,000,000.00	5,260,650.00	0.69
TRSOTKO32110	5,000,000.00	5,094,500.00	0.67
TRSOTKO72116	9,500,000.00	9,435,020.00	1.24
TRSRNSH22023	5,000,000.00	5,154,450.00	0.68
TRSTISB72712	5,000,000.00	5,182,400.00	0.68
TRSVKFB92719	5,000,000.00	5,404,300.00	0.71
TOPLAM	65,660,000.00	67,350,300.30	8.88
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
TRD100221T17	110,000.00	128,459.10	0.02
TRD100822T10	160,000.00	172,971.20	0.02
TRD120220T16	70,000.00	74,278.40	0.01
TRD140721T18	140,000.00	140,919.80	0.02
TRD151221T10	40,000.00	42,282.00	0.01
TRD160621T17	80,000.00	93,980.80	0.01
TRD180821T13	10,000.00	11,471.20	0.00
TRD230920T24	1,400,000.00	1,653,638.00	0.22

TRD260122T19		20,350,000.00	20,514,021.00	2.71
TOPLAM		22,360,000.00	22,832,021.50	3.01
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
TRT050220T17		53,121.00	55,041.36	0.01
TRT050220T17		46,359,792.00	48,041,740.28	6.34
TRT050624T19		5,013,500.00	5,004,421.92	0.66
TOPLAM		51,426,413.00	53,101,203.56	7.00
L) DİĞER	:			
Vadeli Mevduat gün 94		10,000,000.00	10,007,896.49	1.32
TOPLAM			10,007,896.49	1.32
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	:	758,254,255.55		
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	10,769.39		
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00		
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00		
E. BORÇLAR (-)	:	1,740,810.98		
FON TOPLAM DEĞERİ	:	756,524,213.96		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	:			
Açıklama		Tutarı		
37001 Fon Yönetim Ücreti		1,683,700.57		
37002 Denetim Ücreti		857.67		
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı		4,193.22		
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı		23,001.39		
37005 Vergi, Resim ve Harçlar		58.80		
37006 Saklama Giderleri		13,733.93		
37008 Banka Masrafları		978.08		
37009 Noter Tasdik ve Ücreti		106.54		
37010 Kap Gideri		281.49		
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti		14,115.66		
37028 Portföy Saklama Hizmeti		5,152.00		
37030 E-fatura Gideri		118.00		
37098 Küsürat farkları		40.37		
37099 Diğer Giderler		156.42		
Toplam		1,746,494.14		
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
TRFFNYM12016	08.01.2020	10000000.00
TRFDNFK12014	10.01.2020	10000000.00
TRFVKFB12029	10.01.2020	1330000.00
TRFISFN12016	13.01.2020	10000000.00
TRT150120T32	15.01.2020	10000000.00
TRB220120T17	22.01.2020	52500000.00
TRFDZBK12058	24.01.2020	10000000.00
TRFYKYM12021	29.01.2020	10000000.00
TRFFNBK12075	31.01.2020	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
------------------------	---------------	---------	-------------	--------------------