

YKP**(YOA) YAPI KREDİ PORTFOY PY BORCLANMA ARAÇLARI (DOVİZ) ÖZEL FONU****ŞUBAT 2020 AYLIK RAPORUDUR.****1- FONU TANITICI BİLGİLER**

A. FONUN ADI	:	(YOA) YAPI KREDİ PORTFOY PY BORCLANMA ARAÇLARI (DOVİZ) ÖZEL FONU
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFOY YONETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	50,000,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	432,140,223.04
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	59,854,728.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	09.06.2016
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	7.219818
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	7.202552
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	0.24%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	3.90%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	28.34%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		8.62%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		0.00%
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		1.29%
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		0.16%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		89.02%

Yabancı Hisse Senetleri	0.00%
VIOP Nakit Teminat	0.43%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	0.00%
Vadeli_YP	0.41%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	0.00%
Katılma Belgesi YP	0.01%
Katılım Hesabı	0.00%
CC Swap	0.00%
FX Swap	0.05%
IR Swap	0.00%
CD Swap	0.00%
VDMK	0.00%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	0.12%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	4.29%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	1229.412
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	17,232,423.05
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	10,823,132.54

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	2,500,000.00	17,432,828.28	4.07
TRT171221F16	1,100,000.00	7,585,410.94	1.77
TOPLAM	3,600,000.00	25,018,239.22	5.85
F) FİNANSMAN BONOLARI			
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ			
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
H) KİRA SERTİFİKALARI			
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER			
US900123BZ27	2971000.00	19608087.66	4.58
US900123CF53	18050000.00	116346668.12	27.19
US900123CL22	2000000.00	12709116.45	2.97
US900123CT57	3000000.00	20590109.70	4.81

US900123CW86	400000.00	2532085.98	0.59
XS0847042024	1564000.00	9770219.70	2.28
XS0849728190	6400000.00	40169706.03	9.39
XS0861979440	5700000.00	35170193.15	8.22
XS1003016018	2117000.00	13941322.70	3.26
XS1508390090	980000.00	6242873.05	1.46
XS1605397394	5700000.00	35607578.19	8.32
XS1711581337	3100000.00	19186032.28	4.48
XS1750996206	3000000.00	18465521.33	4.32
XS1772360803	1000000.00	5937205.02	1.39
XS1788516679	800000.00	5161545.04	1.21
XS1917720911	1030000.00	6837645.10	1.60
XS1961766596	3000000.00	19971691.06	4.67
XS2106022754	1800000.00	10733924.77	2.51
TOPLAM	62,612,000.00	398,981,525.33	93.24
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TRT210721T11	439,415.00	1,000,893.42	0.23
TOPLAM	439,415.00	1,000,893.42	0.23
L) DİĞER	:		
FX Swap YOA-0806/EURUSD	3,600,000.00	-351,122.27	-0.08
YPL	325,000.00	2,250,718.10	0.53
BPP	363,338.63	363,338.63	0.08
TOPLAM		2,262,934.47	0.53
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		
	663,866.25	663,866.25	0.16
TOPLAM	663,866.25	663,866.25	0.16
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
O) VDMK	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU	:		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	427,927,458.69	
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	8,452.76	
C. ALACAKLAR (+)	:	5,387,824.69	
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00	
E. BORÇLAR (-)	:	1,183,513.10	
FON TOPLAM DEĞERİ	:	432,140,223.04	
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	:		
Açıklama		Tutarı	
37001 Fon Yönetim Ücreti		166,518.24	
37002 Denetim Ücreti		729.12	
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı		5.10	
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı		1,148.70	

370034	Yabancı Menkul Komisyonu	467.95
37005	Vergi, Resim ve Harçlar	215,629.90
37006	Saklama Giderleri	4,856.59
37008	Banka Masrafları	48.46
37010	Kap Gideri	238.84
37015	Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	458.67
37021	Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	6,753.35
37023	VIOP İşlemi Komisyonu	7,159.33
37028	Portföy Saklama Hizmeti	2,912.00
37030	E-fatura Gideri	118.00
37098	Küsürat farkları	1.53
37099	Diğer Giderler	123.20
Toplam		407,168.98

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

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