

YKP
(YOT) YAPI KREDİ PORTFOY ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
ŞUBAT 2020 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	(YOT) YAPI KREDİ PORTFOY ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	9,487,209.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	207,732,369.76
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	28,007,340.01
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	29.08.1996
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	7.417069
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	7.593151
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	-2.32%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	0.21%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	20.27%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		74.31%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		12.65%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		1.32%
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		6.66%
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		0.22%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.00%

Yabancı Hisse Senetleri	0.00%
VIOP Nakit Teminat	0.79%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	1.40%
Vadeli_YP	0.00%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	2.38%
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	0.27%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 0.06%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	119.06%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 457.354
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 49,337,469.95
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	: 124,544,404.07

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT020322T17	200,000.00	207,004.00	0.10
TRT080323T10	40,000.00	35,588.00	0.02
TRT080328T15	100,000.00	103,026.00	0.05
TRT080720T19	18,064,000.00	18,179,790.24	8.73
TRT110226T13	10,500,000.00	9,525,390.00	4.57
TRT120122T17	61,000.00	58,830.84	0.03
TRT120325T12	13,000.00	11,149.58	0.01
TRT120820T12	10,500,000.00	11,133,360.00	5.35
TRT130520T14	17,000,000.00	16,643,510.00	7.99
TRT140421T13	10,000,000.00	8,794,100.00	4.22
TRT140623T19	3,300,000.00	3,676,860.00	1.77
TRT140922T17	2,592,000.00	2,467,635.84	1.18
TRT160920T25	7,500,000.00	7,060,200.00	3.39
TRT170221T12	400,000.00	395,804.00	0.19
TRT180123T10	5,500,000.00	5,465,130.00	2.62
TRT200324T13	15,000.00	14,528.55	0.01
TRT201021T25	18,500,000.00	19,878,065.00	9.54
TRT210421T14	14,000,000.00	16,304,820.00	7.83

TRT220921T18	25,500,000.00	25,663,965.00	12.32
TRT240227T17	200,000.00	193,638.00	0.09
TRT240724T15	1,722,000.00	1,517,805.24	0.73
TRT270923T11	1,641,000.00	1,500,661.68	0.72
TOPLAM	147,348,000.00	148,830,861.97	71.45
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ	:		
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)	:		
E) DÖVİZE ENDEKSİ TAHVİLLER	:		
F) FİNANSMAN BONOLARI	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSAKFH22212	1,500,000.00	1,512,780.00	0.73
TR SARCL22117	1,000,000.00	1,015,030.00	0.49
TR SARCL72112	1,800,000.00	1,838,610.00	0.88
TRSCMSA32112	500,000.00	513,365.00	0.25
TR SENSEA72211	2,450,000.00	3,492,254.50	1.68
TRSKCTF32014	1,000,000.00	1,067,050.00	0.51
TRSKCTY32015	100,000.00	103,249.00	0.05
TRSKFTF42016	1,300,000.00	1,377,584.00	0.66
TRSKRSNE2018	1,000,000.00	1,021,130.00	0.49
TR SOPAS22111	1,500,000.00	1,496,295.00	0.72
TRSORFN72013	1,500,000.00	1,535,475.00	0.74
TR SOTKO32110	1,500,000.00	1,578,495.00	0.76
TRSTHALE2716	800,000.00	799,512.00	0.38
TRSTISB72712	100,000.00	100,981.00	0.05
TRSTISB92918	800,000.00	818,600.00	0.39
TRSVKFB92719	2,000,000.00	2,183,880.00	1.05
TRSYKKB62914	2,700,000.00	2,746,197.00	1.32
TRSYKKB92911	1,000,000.00	1,018,260.00	0.49
XS1629734879	3,350,000.00	3,430,952.75	1.65
TOPLAM	25,900,000.00	27,649,700.25	13.27
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
TRD260122T19	900,000.00	898,983.00	0.43
TOPLAM	900,000.00	898,983.00	0.43
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TRT050624T19	9,980,770.00	10,009,008.22	4.81
TRT061124T11	1,914,465.00	2,001,800.00	0.96
TRT261022T10	3,849,935.00	8,007,200.00	3.84
TOPLAM	15,745,170.00	20,018,008.22	9.61
L) DİĞER	:		
YPK	2,922,534.00	5,126,188.93	2.46
Vadeli Mevduat gün 94	3,000,000.00	3,024,569.54	1.45
F_XAUUSD0420	1,000.00	10,071,980.94	

BPP	597,529.94	597,529.94	0.29
TOPLAM		8,748,288.41	4.20

M) VARANT :

N) VIOP NAKİT TEMİNAT :

	1,554,554.63	1,554,554.63	0.75
TOPLAM	1,554,554.63	1,554,554.63	0.75

O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER :

VALÖRLÜ İŞLEMLER :

O) VDMK :

TRPTYV232410

TOPLAM

VALÖRLÜ İŞLEMLER :

	500,000.00	591,055.00	0.28
TOPLAM	500,000.00	591,055.00	0.28

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU :

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	208,291,451.48
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	6,375.31
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	565,457.03
FON TOPLAM DEĞERİ	:	207,732,369.76

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER :

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	492,683.39
37002 Denetim Ücreti	688.24
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	2,730.98
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	3,591.00
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	150.50
37006 Saklama Giderleri	2,377.35
37008 Banka Masrafları	327.01
37010 Kap Gideri	140.84
370142 KYD Endeks Lisans Giderleri	2,230.20
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	323.73
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	3,329.97
37023 VIOP İşlemi Komisyonu	2,968.09
37028 Portföy Saklama Hizmeti	2,912.00
37030 E-fatura Gideri	118.00
Toplam	514,571.30

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		
TRT050220T17		05.02.2020	400000.00		
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