

YKP**(YBE) YAPI KREDİ PORTFOY EUROBOND (DOLAR) BORCLANMA ARAÇLARI FONU****MART 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	:	1,933,301,835.96
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	11,526,727,371.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	29.06.2000
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.167723
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.175046
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	-4.18%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	-2.25%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	17.52%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		7.76%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		1.15%
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		1.28%
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)		88.78%

Yabancı Hisse Senetleri	0.00%
VIOP Nakit Teminat	0.86%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	0.00%
Vadeli_YP	0.07%
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	0.01%
IR Swap	0.00%
CD Swap	0.00%
VDMK	0.06%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 23.93%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	3.35%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 2168.344
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 68,512,140.55
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	: 207,748,120.16

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	125,002,727.40	6.42
TRT171221F16	2,740,000.00	20,236,235.39	1.04
TOPLAM	19,630,000.00	145,238,962.79	7.46
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFDGOZ71915	1,237,069.00	1,237,069.00	0.06
TOPLAM	1,237,069.00	1,237,069.00	0.06
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ			
TRSKFTF42016	4,800,000.00	5,132,688.00	0.26
TRSKRSNE2018	400,000.00	413,468.00	0.02
TRSOPAS42010	8,000,000.00	8,570,480.00	0.44
TRSYKBK62914	4,500,000.00	4,621,950.00	0.24
TOPLAM	17,700,000.00	18,738,586.00	0.96
VALÖRLÜ İŞLEMLER			

H) KİRA SERTİFİKALARI	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
US900123AT75		9914000.00	65486955.39	3.36
US900123AW05		6720000.00	44043744.14	2.26
US900123AY60		28250000.00	164929331.70	8.47
US900123BB58		10051000.00	60929490.71	3.13
US900123BG46		11250000.00	64927808.46	3.33
US900123BJ84		3885000.00	20382329.52	1.05
US900123CF53		24270000.00	149207874.87	7.66
US900123CG37		23300000.00	127738316.96	6.56
US900123CL22		15400000.00	90639345.60	4.65
US900123CM05		18966000.00	95229172.40	4.89
US900123CP36		4000000.00	22223905.66	1.14
US900123CQ19		33000000.00	197249316.53	10.13
US900123CR91		13150000.00	86368642.44	4.43
US900123CT57		13000000.00	84415812.42	4.33
XS0847042024		6553000.00	39969458.16	2.05
XS0849728190		6654000.00	40590526.07	2.08
XS0861979440		2600000.00	15525311.57	0.80
XS1003016018		2343000.00	14710373.97	0.76
XS1376681067		163000.00	958850.50	0.05
XS1390320981		2000000.00	12979558.72	0.67
XS1571399754		4363000.00	27758555.32	1.43
XS1578203462		7470000.00	44934707.05	2.31
XS1584113184		141000.00	831023.72	0.04
XS1605397394		800000.00	4937816.47	0.25
XS1622626379		695000.00	4389264.07	0.23
XS1684378208		11834000.00	69219557.20	3.55
XS1711581337		1800000.00	11113871.16	0.57
XS1750996206		10490000.00	62991850.81	3.23
XS1788516679		5200000.00	31921239.67	1.64
XS1958649854		2000000.00	13004588.90	0.67
XS1961766596		4500000.00	27486237.38	1.41
XS1970705528		1000000.00	6296501.73	0.32
XS2100270508		1200000.00	6891142.50	0.35
XS2106022754		6700000.00	35736189.96	1.83
TOPLAM		293,662,000.00	1,746,018,671.72	89.65
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
TRT070727T13		5,905,165.00	8,502,074.93	0.44
TRT111120T18		9,509,565.00	10,002,438.36	0.51
TOPLAM		15,414,730.00	18,504,513.29	0.95
L) DİĞER	:			
FX Swap YBE-2104/USDEUR		14,000,000.00	1,166,373.99	0.06
YPL		325,000.00	2,367,152.03	0.12
F_EURUSD0420		-6,000.00	-43,359,360.00	
F_USDTRY0420		-12,200.00	-80,821,340.00	

BPP		53,013.21	53,013.21	0.00
TOPLAM			3,586,539.23	0.18
M) VARANT	:			
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:			
		13,193,976.92	13,193,976.92	0.68
TOPLAM		13,193,976.92	13,193,976.92	0.68
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
O) VDMK	:			
TRPTYV232410		1,000,000.00	1,151,640.00	0.06
TOPLAM		1,000,000.00	1,151,640.00	0.06
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU	:			
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	1,947,669,958.95		
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	13,131.44		
C. ALACAKLAR (+)	:	6,548,540.75		
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00		
E. BORÇLAR (-)	:	19,692,726.18		
FON TOPLAM DEĞERİ	:	1,933,301,835.96		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	:			
Açıklama			Tutarı	
37001 Fon Yönetim Ücreti		5,007,120.75		
37002 Denetim Ücreti		807.63		
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı		376.25		
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı		6,384.00		
370034 Yabancı Menkul Komisyonu		144.58		
37005 Vergi, Resim ve Harçlar		49,544.61		
37006 Saklama Giderleri		25,607.96		
37008 Banka Masrafları		132.83		
37010 Kap Gideri		326.70		
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu		499.42		
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti		27,810.89		
37023 VIOP İşlemi Komisyonu		112,751.35		
37028 Portföy Saklama Hizmeti		5,152.00		
37030 E-fatura Gideri		118.00		
37099 Diğer Giderler		611.00		
Toplam		5,237,387.97		
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		
TRSKCTF32014		23.03.2020	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