

YKP
(YBS) YAPI KREDİ PORTFOY ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
MAYIS 2020 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	(YBS) YAPI KREDİ PORTFOY ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFOY YÖNETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	600,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	822,198,784.88
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	33,361,370,334.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	25.01.2012
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.024645
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.024509
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	0.55%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	3.86%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	14.80%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		0.47%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		83.83%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		1.39%
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		11.28%
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		0.07%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.00%

Yabancı Hisse Senetleri	0.00%
VIOP Nakit Teminat	0.26%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	1.96%
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. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	32.04%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	44.42%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	75.217
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	116,903,118.13
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	18,768,743.89

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT260122T11	500,000.00	501,360.00	0.06
TOPLAM	500,000.00	501,360.00	0.06
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFAKBK620T0	5,000,000.00	4,975,700.00	0.60
TRFAKBK72050	25,000,000.00	24,823,250.00	3.00
TRFAKBKE2014	3,000,000.00	2,892,990.00	0.35
TRFAKYM72017	14,000,000.00	13,905,640.00	1.68
TRFDFT82014	3,000,000.00	2,941,830.00	0.36
TRFDGOZ71915	1,254,742.00	1,254,742.00	0.15
TRFDNFK72018	10,000,000.00	9,865,500.00	1.19
TRFDNFK92016	20,000,000.00	19,358,600.00	2.34
TRFDZBK82036	20,000,000.00	19,590,800.00	2.37
TRFDZBK92019	10,000,000.00	10,203,000.00	1.23
TRFDZBK92043	30,000,000.00	29,233,800.00	3.53

TRFEGYO62014	10,000,000.00	9,995,500.00	1.21
TRFFFKR72014	3,000,000.00	2,962,230.00	0.36
TRFFNBK72038	30,000,000.00	29,672,400.00	3.58
TRFFNBK92036	10,000,000.00	10,183,600.00	1.23
TRFGRAN62018	15,000,000.00	15,047,700.00	1.82
TRFGRAN62034	4,750,000.00	4,736,272.50	0.57
TRFGRAN72033	15,000,000.00	14,851,500.00	1.79
TRFGRAN72058	15,000,000.00	14,829,000.00	1.79
TRFGRAN72066	5,000,000.00	4,932,200.00	0.60
TRFGRFA82012	15,460,000.00	15,171,361.80	1.83
TRFHLFKE2012	9,500,000.00	9,226,115.00	1.11
TRFISFA82024	16,590,000.00	16,219,877.10	1.96
TRFISFA92015	5,260,000.00	5,111,562.80	0.62
TRFISGY82014	5,140,000.00	5,036,840.20	0.61
TRFKFTFE2016	5,000,000.00	4,818,050.00	0.58
TRFMCBKF2019	7,000,000.00	6,724,900.00	0.81
TRFOYMD62014	6,000,000.00	5,994,720.00	0.72
TRFTCZB82013	8,870,000.00	8,877,805.60	1.07
TRFTCZB82021	19,000,000.00	19,475,760.00	2.35
TRFTCZB92012	4,000,000.00	4,073,120.00	0.49
TRFTEBK72012	30,000,000.00	29,699,700.00	3.59
TRFTHAL82030	7,000,000.00	7,017,220.00	0.85
TRFTISB72032	28,000,000.00	27,767,880.00	3.35
TRFTISB72081	10,000,000.00	9,917,000.00	1.20
TRFVFAS72010	10,000,000.00	9,920,200.00	1.20
TRFVKFB72080	5,880,000.00	5,809,204.80	0.70
TRFVKFB82022	15,000,000.00	15,047,400.00	1.82
TRFVKFB92013	5,000,000.00	5,024,500.00	0.61
TRFVKFB92039	6,700,000.00	6,547,039.00	0.79
TRFYKBK72035	10,000,000.00	9,859,300.00	1.19
TRFYKBK82026	10,000,000.00	10,007,000.00	1.21
TRFYKBK82042	10,000,000.00	9,845,100.00	1.19
TRFYKBK82067	10,000,000.00	9,830,600.00	1.19
TRFYKYM72017	10,000,000.00	9,917,300.00	1.20
TOPLAM	518,404,742.00	513,195,810.80	61.97
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSAKFH22212	7,000,000.00	7,034,790.00	0.85
TRSAKYP41612	3,253,744.00	3,421,018.98	0.41
TR SARCL22117	5,000,000.00	5,109,000.00	0.62
TR SAYGZ62110	2,100,000.00	2,121,336.00	0.26
TRSBOLU72119	2,500,000.00	2,536,325.00	0.31
TRSCMSA32112	3,190,000.00	3,266,464.30	0.39
TR SDEVA42219	6,000,000.00	6,079,680.00	0.73
TR SENSEA72211	5,000,000.00	7,377,750.00	0.89
TR SERGL52117	3,500,000.00	3,502,380.00	0.42
TRSGRAN23013	11,250,000.00	11,310,750.00	1.37
TR SISGY32111	3,640,000.00	3,732,892.80	0.45
TRSKALE62114	5,000,000.00	5,143,600.00	0.62

TRSKCTY62012	4,000,000.00	4,252,080.00	0.51
TRSKFTF62113	4,000,000.00	4,098,360.00	0.49
TRSKRSNE2018	200,000.00	204,560.00	0.02
TRSOPAS22111	10,900,000.00	10,929,430.00	1.32
TRSOPAS22129	10,000,000.00	10,012,300.00	1.21
TRSORFN72013	3,490,000.00	3,552,156.90	0.43
TRSOTKO32110	5,000,000.00	5,205,150.00	0.63
TRSSRTN72114	2,500,000.00	2,542,425.00	0.31
TRSTBTF32116	10,000,000.00	10,079,000.00	1.22
TRSTHALE2716	3,200,000.00	3,189,952.00	0.39
TRSTISB22212	10,000,000.00	10,048,200.00	1.21
TRSTISB72712	11,000,000.00	11,116,600.00	1.34
TRSTISB92918	8,000,000.00	8,237,520.00	0.99
TRSTPRS12115	3,000,000.00	3,023,340.00	0.37
TRSVKFB92719	3,000,000.00	3,268,680.00	0.39
TRSYAZI52216	14,000,000.00	14,074,060.00	1.70
TRSYKKBK32115	10,000,000.00	10,024,600.00	1.21
TRSYKKBK62914	4,500,000.00	4,554,675.00	0.55
TRSYKKBK92911	10,000,000.00	10,115,300.00	1.22
TOPLAM	184,223,744.00	189,164,375.98	22.84
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
TRD100221T17	110,000.00	122,892.00	0.01
TRD140721T18	780,000.00	817,869.00	0.10
TRD160621T17	1,930,000.00	2,363,902.60	0.29
TRD180821T13	460,000.00	513,999.40	0.06
TRD220921T16	3,000,000.00	4,888,770.00	0.59
TRD230920T24	1,220,000.00	1,337,534.80	0.16
TRD260122T19	10,000.00	10,491.80	0.00
TOPLAM	7,510,000.00	10,055,459.60	1.21
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TRT060825T15	20,046,850.00	20,013,972.60	2.42
TRT110226T13	12,167,260.00	11,508,034.25	1.39
TRT140623T19	7,607,180.00	9,006,287.67	1.09
TRT261022T10	5,130,515.00	11,007,666.85	1.33
TRT261022T10	18,656,430.00	40,027,912.32	4.83
TOPLAM	63,608,235.00	91,563,873.69	11.06
L) DİĞER	:		
Vadeli Mevduat gün 45	15,495,426.23	15,604,845.30	1.88
BPP	109,081.08	109,081.08	0.01
TOPLAM		15,713,926.38	1.90
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		
	2,078,594.10	2,078,594.10	0.25
TOPLAM	2,078,594.10	2,078,594.10	0.25

O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
O) VDMK	:			
TRPTYV232410		5,000,000.00	5,874,150.00	0.71
TOPLAM		5,000,000.00	5,874,150.00	0.71
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	828,147,550.55
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	4,995.62
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	1,278,000.32
FON TOPLAM DEĞERİ	:	822,198,784.88

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	1,113,624.93
37002 Denetim Ücreti	966.00
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	1,752.57
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	22,356.63
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	371.10
37006 Saklama Giderleri	17,419.90
37008 Banka Masrafları	1,239.06
37010 Kap Gideri	290.08
370142 KYD Endeks Lisans Giderleri	1,752.30
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	303.08
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	12,374.12
37028 Portföy Saklama Hizmeti	4,025.00
37030 E-fatura Gideri	118.00
37099 Diğer Giderler	217.28
Toplam	1,176,810.05

6- GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI, BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIM, TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

Açıklama	Giriş Tarihi	Stok	Kazanılan Nominal
----------	--------------	------	-------------------

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR

8- İTFALAR

Menkul Kıymet Türü	İtfat Tarihi	Nominal
TRFISMD52050	05.05.2020	5000000.00
TRFYKYM52019	06.05.2020	4000000.00
TRFFNBK52014	08.05.2020	5000000.00
TRFVKFB52033	08.05.2020	10000000.00
TRFAKBK52011	11.05.2020	5000000.00

TRFTISB52018	11.05.2020	30000.00
TRFHLFK52015	13.05.2020	15000000.00
TRFISFN52012	15.05.2020	9630000.00
TRFAKBK52037	18.05.2020	25000000.00
TRFISFN52020	22.05.2020	20000000.00
TRFISGY52017	29.05.2020	11500000.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR :

10- ÖDÜNÇ İŞLEMLER :

A) ÖDÜNÇ VERİLEN :

Sermaye Piyasası Aracı :

B) ÖDÜNÇ ALINAN :

Sermaye Piyasası Aracı :

Menkul Kıymet

Nominal

Vade Tarihi

Cari Piyasa Değeri

Menkul Kıymet

Nominal

Vade Tarihi

Cari Piyasa Değeri