

YKP
(YDP) YAPI KREDİ PORTFOY PY ÜÇÜNCÜ DEĞİSKEN ÖZEL FON
MAYIS 2020 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	(YDP) YAPI KREDİ PORTFOY PY ÜÇÜNCÜ DEĞİSKEN ÖZEL FON
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFOY YONETİMİ AS
Ç. FON TUTARI	:	300,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	787,565,813.37
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	29,234,878,322.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	20.07.2012
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.026939
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.026764
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	0.65%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	5.26%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	26.92%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		7.45%
Devlet Tahvili		34.69%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		12.45%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		3.33%
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		19.95%
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)		8.01%

Yabancı Hisse Senetleri	0.00%
VIOP Nakit Teminat	0.72%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	3.88%
Vadeli_YP	0.09%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	9.18%
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	0.23%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 58.47%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	13.78%
Devlet Borçlanma Senetleri	15.87%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 753.764
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 0.00
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	: 0.00

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
AEFES	115,000.00	2,132,100.00	0.27
AKBNK	650,000.00	3,698,500.00	0.48
ASELS	50,000.00	1,509,000.00	0.19
BIMAS	60,000.00	3,906,000.00	0.50
CCOLA	51,000.00	2,066,520.00	0.27
DOHOL	1,000,000.00	1,910,000.00	0.25
EKGYO	1,000,000.00	1,470,000.00	0.19
ENKAI	0.61	3.34	0.00
EREGL	505,009.00	4,065,322.45	0.52
GARAN	450,000.00	3,519,000.00	0.45
ISCTR	200,000.00	990,000.00	0.13
ISGYO	1.08	1.80	0.00
ISMEN	290,000.00	1,679,100.00	0.22
KAREL	60,000.00	915,600.00	0.12
KCHOL	185,000.00	2,985,900.00	0.38
ODAS	1.18	2.29	0.00
OTKAR	6,500.00	867,750.00	0.11
SAHOL	125,000.00	1,037,500.00	0.13
SISE	500,000.53	2,420,002.57	0.31

SODA	345,000.02	1,945,800.10	0.25
TCELL	272,500.00	3,858,600.00	0.50
THYAO	150,000.00	1,890,000.00	0.24
TKFEN	100,001.00	1,401,014.01	0.18
TOASO	41,500.00	922,960.00	0.12
TSKB	1,200,000.00	1,320,000.00	0.17
TTKOM	600,000.00	4,458,000.00	0.57
TUPRS	37,000.00	3,170,900.00	0.41
VAKBN	500,001.00	2,325,004.65	0.30
YATAS	160,000.00	1,188,800.00	0.15
YKBNK	1,350,000.32	3,132,000.74	0.40
TOPLAM	10,003,514.74	60,785,381.95	7.83
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI	:		
TRT030523T13	5,000,000.00	9,981,100.00	1.29
TRT080328T15	100,000.00	104,478.00	0.01
TRT090621T18	45,000,000.00	41,457,600.00	5.34
TRT110226T13	28,500,000.00	27,831,675.00	3.59
TRT110827T16	269,000.00	257,376.51	0.03
TRT120325T12	20,000.00	17,633.20	0.00
TRT120820T12	10,200,000.00	11,214,900.00	1.45
TRT140623T19	300,000.00	366,021.00	0.05
TRT160425T17	1,000,000.00	1,674,200.00	0.22
TRT170221T12	300,000.00	314,772.00	0.04
TRT170822T15	6,100,000.00	6,391,092.00	0.82
TRT180123T10	200,000.00	219,246.00	0.03
TRT200324T13	67,000.00	66,495.49	0.01
TRT201021T25	29,000,000.00	31,227,490.00	4.02
TRT210421T14	12,000,000.00	13,568,160.00	1.75
TRT220921T18	82,200,000.00	84,102,930.00	10.84
TRT240227T17	10,000,000.00	9,734,400.00	1.25
TRT240724T15	22,000.00	20,950.38	0.00
TRT261022T10	500,000.00	1,096,405.00	0.14
TOPLAM	230,778,000.00	239,646,924.58	30.88
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ	:		
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)	:		
E) DÖVİZE ENDEKSİLİ TAHVİLLER	:		
TRT171221F16	2,270,000.00	17,557,201.64	2.26
TRT280521F20	0.00	0.00	0.00
TOPLAM	2,270,000.00	17,557,201.64	2.26
F) FİNANSMAN BONOLARI	:		
TRFTCZB82013	3,550,000.00	3,553,124.00	0.46
TOPLAM	3,550,000.00	3,553,124.00	0.46
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSARCL22117	9,280,000.00	9,482,304.00	1.22
TRSARCL72112	7,660,000.00	7,889,110.60	1.02
TRSAYGZ62110	2,800,000.00	2,828,448.00	0.36
TRSENSA72211	5,100,000.00	7,525,305.00	0.97

TRSERGL52117	2,900,000.00	2,901,972.00	0.37
TRSGRAN23013	4,900,000.00	4,926,460.00	0.63
TRSKCTY62012	1,000,000.00	1,063,020.00	0.14
TRSKFTF62113	360,000.00	368,852.40	0.05
TRSKRSNE2018	2,000,000.00	2,045,600.00	0.26
TRSOPAS22111	1,000,000.00	1,002,700.00	0.13
TRSOPAS22129	4,410,000.00	4,415,424.30	0.57
TRSOTKO32110	8,000,000.00	8,328,240.00	1.07
TRSTHALE2716	500,000.00	498,430.00	0.06
TRSTISB72712	5,140,000.00	5,194,484.00	0.67
TRSTISB92918	8,000,000.00	8,237,520.00	1.06
TRSTPRS12115	4,000,000.00	4,031,120.00	0.52
TRSVKFB92719	2,170,000.00	2,364,345.20	0.30
TRSYKBK62914	6,300,000.00	6,376,545.00	0.82
TRSYKBK92911	10,000,000.00	10,115,300.00	1.30
XS1629734879	2,350,000.00	2,496,099.50	0.32
TOPLAM	87,870,000.00	92,091,280.00	11.87
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
TRD260122T19	24,750,000.00	25,967,205.00	3.35
TOPLAM	24,750,000.00	25,967,205.00	3.35
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
US900123CG37	10000000.00	59979496.57	7.73
TOPLAM	10,000,000.00	59,979,496.57	7.73
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TRT080328T15	15,819,305.00	16,011,506.85	2.06
TRT110226T13	13,225,400.00	12,508,845.89	1.61
TRT200324T13	19,146,410.00	18,513,228.77	2.39
TRT210421T14	3,652,990.00	4,002,833.97	0.52
TRT210721T11	1,484,545.00	3,502,476.85	0.45
TRT210721T11	19,511,345.00	46,033,082.18	5.93
TRT230222T13	8,080,530.00	18,012,945.21	2.32
TRT240227T17	21,092,110.00	20,014,301.37	2.58
TRT240227T17	21,092,195.00	20,014,383.56	2.58
TRT280628T18	1,103,760.00	1,501,067.67	0.19
TRT280628T18	1,103,765.00	1,501,072.60	0.19
TOPLAM	125,312,355.00	161,615,744.92	20.83
L) DİĞER	:		
Forward EURO/TL	-1,633,672.18		
Forward USD/TL	-451,009.98		
GLDTRF	2,000,000.00	67,880,000.00	8.75
YPF	1,094,719.00	1,861,493.03	0.24
YSF	1,235,967.00	1,175,373.72	0.15
YPL	400,000.00	3,032,528.02	0.39
Vadeli Mevduat YP gün 4	451,007.52	3,073,091.80	0.40
Vadeli Mevduat gün 44	15,000,000.00	15,121,557.45	1.95

Vadeli Mevduat gün 44	15,000,000.00	15,124,929.31	1.95
BPP	164,111.21	164,111.21	0.02
TOPLAM		107,433,084.54	13.84

M) VARANT :
N) VIOP NAKİT TEMİNAT :

	5,624,230.71	5,624,230.71	0.72
TOPLAM	5,624,230.71	5,624,230.71	0.72

O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER :
VALÖRLÜ İŞLEMLER :

O) VDMK :
TRPTYV232410 1,500,000.00 1,762,245.00 0.23

TOPLAM 1,500,000.00 1,762,245.00 0.23
VALÖRLÜ İŞLEMLER :

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU :

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	776,015,918.91	
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	4,792.87	
C. ALACAKLAR (+)	:	30,661,648.05	
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00	
E. BORÇLAR (-)	:	19,116,546.46	
FON TOPLAM DEĞERİ	:	787,565,813.37	

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER :

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	120,547.98
37002 Denetim Ücreti	813.96
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	638.77
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	37,354.80
370034 Yabancı Menkul Komisyonu	507.00
37004 Aracılık Komisyonu	7,261.12
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	1,144.28
37006 Saklama Giderleri	7,717.81
37008 Banka Masrafları	151.78
37010 Kap Gideri	304.92
370142 KYD Endeks Lisans Giderleri	3,982.50
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	117.16
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	12,176.62
37023 VIOP İşlemi Komisyonu	2,702.93
37028 Portföy Saklama Hizmeti	4,025.00
37030 E-fatura Gideri	118.00
37099 Diğer Giderler	274.68
Toplam	199,839.31

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

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

BIMAS Tem :%50.00	13.05.2020	74000.00	37000.00
ENKAI Bds :%12.00	27.05.2020	0.54	0.07
CCOLA Tem :%94.00	28.05.2020	51000.00	47940.00
SISE Tem :%14.22	29.05.2020	500000.53	71111.18
SODA Tem :%24.50	29.05.2020	345000.02	84525.00

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR :

8- İTFALAR :

Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal
TRFTISB52018	11.05.2020	200000.00

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
------------------------	---------------	---------	-------------	--------------------