

YKP
(YHT) YAPI KREDİ PORTFOY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
NİSAN 2020 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	(YHT) YAPI KREDİ PORTFOY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	387,343,250.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	1,166,898,517.53
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	14,989,912,946.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	31.07.2002
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.077846
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.077031
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.06%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	3.14%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	16.01%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		43.41%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		40.15%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		0.65%
Kira Sertifikası-Kamu-YP		0.00%
Kira Sertifikası-Özel Sektör-TL		0.01%
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		9.36%
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		0.75%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.00%

Yabancı Hisse Senetleri	0.00%
VIOP Nakit Teminat	0.00%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	5.68%
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	0.00%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 19.41%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	96.74%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 78.853
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 1,112,373,332.87
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	: 576,184,547.42

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT071020T23	71,500,000.00	69,265,625.00	5.93
TRT080720T19	81,500,000.00	84,269,370.00	7.22
TRT090621T18	5,000,000.00	4,563,950.00	0.39
TRT100620T16	65,500,000.00	65,058,530.00	5.57
TRT120820T12	120,500,000.00	131,789,645.00	11.29
TRT130520T14	48,000,000.00	47,934,720.00	4.11
TRT160920T25	45,000,000.00	43,787,250.00	3.75
TRT170221T12	51,000,000.00	53,231,250.00	4.56
TRT201021T25	1,000,000.00	1,072,570.00	0.09
TRT210421T14	8,500,000.00	9,534,535.00	0.82
TRT220921T18	24,500,000.00	24,933,405.00	2.14
TOPLAM	522,000,000.00	535,440,850.00	45.86
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
TRT170221T12	5,500,000.00	5,746,675.00	0.49
TRT210421T14	3,000,000.00	3,365,130.00	0.29
TRT220921T18	-10,000,000.00	-10,168,800.00	-0.87
TOPLAM	-1,500,000.00	-1,056,995.00	-0.09
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			

D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)	:			
E) DÖVİZE ENDEKSİ TAHVİLLER	:			
F) FİNANSMAN BONOLARI	:			
TRFAKBK52037		50,000,000.00	51,021,000.00	4.37
TRFAKBKE2014		20,000,000.00	19,149,000.00	1.64
TRFDNFK72018		20,000,000.00	19,569,200.00	1.68
TRFDZBK72045		25,000,000.00	24,508,000.00	2.10
TRFDZBK92043		20,000,000.00	19,296,200.00	1.65
TRFFNBK52014		5,000,000.00	4,994,800.00	0.43
TRFFNBK92028		10,000,000.00	10,155,800.00	0.87
TRFGRAN62018		44,000,000.00	44,179,960.00	3.78
TRFISFN52012		5,000,000.00	4,983,650.00	0.43
TRFISFN72010		15,550,000.00	15,256,416.00	1.31
TRFISFN72028		2,670,000.00	2,610,619.20	0.22
TRFISGY52017		2,860,000.00	2,838,349.80	0.24
TRFTCZB82013		8,870,000.00	9,067,534.90	0.78
TRFTCZB92012		9,000,000.00	9,103,860.00	0.78
TRFTEBK72012		35,000,000.00	34,400,450.00	2.95
TRFTISB52018		28,450,000.00	28,388,832.50	2.43
TRFVFAS72010		10,000,000.00	9,830,200.00	0.84
TRFVKFB82022		10,000,000.00	10,196,700.00	0.87
TRFVKFB92013		10,000,000.00	10,055,600.00	0.86
TRFYKBK62028		10,000,000.00	10,095,200.00	0.86
TRFYKBK72035		15,000,000.00	14,688,600.00	1.26
TRFYKBK82026		25,000,000.00	25,388,500.00	2.17
TOPLAM		381,400,000.00	379,778,472.40	32.53
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:			
TRSARCL22117		3,000,000.00	3,070,620.00	0.26
TRSARCL72112		9,010,000.00	9,027,929.90	0.77
TRSIGY32111		4,550,000.00	4,618,659.50	0.40
TRSOPAS22111		9,400,000.00	9,646,562.00	0.83
TRSOTKO32110		5,000,000.00	5,170,350.00	0.44
TRSOTKO72116		9,500,000.00	9,697,505.00	0.83
TRSTISB72712		5,000,000.00	5,165,100.00	0.44
TRSVKFB92719		5,000,000.00	5,392,800.00	0.46
TOPLAM		50,460,000.00	51,789,526.40	4.44
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
H) KİRA SERTİFİKALARI	:			
TRD100221T17		110,000.00	121,467.50	0.01
TRD100822T10		160,000.00	169,377.60	0.01
TRD140721T18		140,000.00	145,254.20	0.01
TRD160621T17		80,000.00	96,705.60	0.01
TRD260122T19		470,000.00	489,105.50	0.04
TRDHVKA52036		10,000.00	10,213.70	0.00
TRDHVKA62019		10,000.00	10,391.40	0.00
TRDHVKA62043		10,000.00	10,235.70	0.00
TRDHVKA72018		10,000.00	10,256.30	0.00
TOPLAM		1,000,000.00	1,063,007.50	0.09

VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
TRT060121T16		1,993.00	5,002.66	0.00
TRT060121T16		1,992,263.00	5,004,854.79	0.43
TRT120122T17		38,747,302.00	40,038,838.36	3.43
TRT170221T12		10,567,575.00	11,010,680.55	0.94
TRT210421T14		9,205,390.00	10,009,841.10	0.86
TRT210721T11		4,551,172.00	11,010,680.55	0.94
TRT230222T13		25,833,580.00	58,056,315.62	4.97
TOPLAM		90,899,275.00	135,136,213.63	11.57
L) DİĞER	:			
Vadeli Mevduat gün 35		10,000,000.00	10,015,729.14	0.86
Vadeli Mevduat gün 39		20,000,000.00	20,031,444.24	1.72
Vadeli Mevduat gün 40		5,000,000.00	5,048,413.51	0.43
Vadeli Mevduat gün 45		10,000,000.00	10,102,017.84	0.87
Vadeli Mevduat gün 45		10,000,000.00	10,015,495.54	0.86
Vadeli Mevduat gün 94		10,000,000.00	10,250,409.84	0.88
TOPLAM			65,463,510.11	5.61
M) VARANT	:			
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:			
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
O) VDMK	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU	:			
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	1,167,614,585.04		
B. HAZİR DEĞERLER (+)	:	12,250.97		
C. ALACAKLAR (+)	:	20,337,197.80		
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00		
E. BORÇLAR (-)	:	21,065,516.28		
FON TOPLAM DEĞERİ	:	1,166,898,517.53		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	:			
Açıklama			Tutarı	
37001 Fon Yönetim Ücreti		1,711,782.35		
37002 Denetim Ücreti		958.98		
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı		6,090.88		
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı		24,903.65		
37005 Vergi, Resim ve Harçlar		58.80		
37006 Saklama Giderleri		16,070.09		
37008 Banka Masrafları		899.32		
37010 Kap Gideri		359.37		
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti		14,342.81		
37028 Portföy Saklama Hizmeti		5,313.00		

37030	E-fatura Gideri	118.00
37098	Küsürat farkları	31.34
37099	Diğer Giderler	323.73
Toplam		1,781,252.32

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
TRFVFAS42013	03.04.2020	10000000.00
TRFISMD42051	07.04.2020	10000000.00
TRFISMD42077	07.04.2020	7000000.00
TRFFNYM42013	08.04.2020	2000000.00
TRFDNFK42011	10.04.2020	20000000.00
TRFGRAN42010	20.04.2020	11600000.00
TRSOPAS42010	21.04.2020	5000000.00
TRSKFTF42016	30.04.2020	4200000.00

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