

YKP**(YBE) YAPI KREDİ PORTFOY EUROBOND (DOLAR) BORCLANMA ARAÇLARI FONU****HAZİRAN 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	:	2,316,857,822.50
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	12,263,535,632.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	29.06.2000
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.188923
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.183031
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	3.22%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	10.11%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	22.37%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		6.17%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		0.26%
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		1.91%
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		0.01%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		90.57%

Yabancı Hisse Senetleri	0.00%
VIOP Nakit Teminat	0.68%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	0.00%
Vadeli_YP	0.35%
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	0.05%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 24.52%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	2.15%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 2258.364
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 149,906,659.27
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	: 154,333,956.74

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	12,650,000.00	98,820,036.08	4.24
TRT171221F16	8,240,000.00	62,250,055.62	2.67
TOPLAM	20,890,000.00	161,070,091.70	6.91
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFDGOZ71915	1,171,093.00	1,171,093.00	0.05
TOPLAM	1,171,093.00	1,171,093.00	0.05
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ			
TRSKRSNE2018	400,000.00	414,412.00	0.02
TRSYKBK62914	4,500,000.00	4,593,780.00	0.20
TOPLAM	4,900,000.00	5,008,192.00	0.21
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
H) KİRA SERTİFİKALARI			
VALÖRLÜ İŞLEMLER			

I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
US900123AT75		5294000.00	40301365.97	1.73
US900123AW05		10479000.00	77838220.24	3.34
US900123AY60		29668000.00	202538830.10	8.69
US900123BB58		9462000.00	66586678.56	2.86
US900123BG46		10593000.00	69042392.36	2.96
US900123BJ84		8685000.00	53209942.47	2.28
US900123CA66		1000000.00	6538164.36	0.28
US900123CF53		24270000.00	167959557.60	7.21
US900123CG37		23800000.00	152670170.16	6.55
US900123CK49		8400000.00	54127891.71	2.32
US900123CL22		20900000.00	142256277.36	6.11
US900123CM05		11966000.00	67870169.45	2.91
US900123CP36		4000000.00	25795579.26	1.11
US900123CQ19		32800000.00	220989099.97	9.49
US900123CR91		11950000.00	85425504.71	3.67
US900123CT57		11985000.00	87651054.32	3.76
XS0847042024		3953000.00	27124748.78	1.16
XS0849728190		6654000.00	45194736.62	1.94
XS0861979440		2600000.00	17515827.35	0.75
XS1003016018		2343000.00	16313003.39	0.70
XS1376681067		163000.00	1138776.64	0.05
XS1390320981		5788000.00	40343178.19	1.73
XS1508390090		2000000.00	13801502.62	0.59
XS1508914691		3900000.00	27068657.40	1.16
XS1571399754		9863000.00	68998258.65	2.96
XS1578203462		7470000.00	50381316.69	2.16
XS1584113184		141000.00	926695.98	0.04
XS1605397394		800000.00	5428190.48	0.23
XS1622626379		695000.00	4747415.60	0.20
XS1684378208		11834000.00	78994310.17	3.39
XS1711581337		1800000.00	12197353.90	0.52
XS1750996206		10490000.00	71868797.72	3.08
XS1772360803		2000000.00	12568357.98	0.54
XS1788516679		5200000.00	35971622.96	1.54
XS1814962582		2000000.00	13470291.74	0.58
XS1917720911		400000.00	2959629.25	0.13
XS1970705528		1000000.00	7201133.58	0.31
XS2100270508		5700000.00	38305297.87	1.64
XS2106022754		3105000.00	20877037.30	0.90
TOPLAM		315,151,000.00	2,134,197,039.47	91.61
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
TRT210721T11		618,385.00	1,500,322.60	0.06
TRT230222T13		3,273,045.00	7,501,613.01	0.32
TOPLAM		3,891,430.00	9,001,935.61	0.39
L) DİĞER	:			
Forward EURO/USD		-13,000,000.00		

YPL	325,000.00	2,494,476.59	0.11
F_EURUSD0820	-3,000.00	-23,114,276.64	
F_USDTRY0820	-17,017.00	-118,676,558.00	
BPP	31,007.43	31,007.43	0.00
TOPLAM		2,525,484.02	0.11
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		
	15,522,842.87	15,522,842.87	0.67
TOPLAM	15,522,842.87	15,522,842.87	0.67
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
O) VDMK	:		
TRPTYV232410	1,000,000.00	1,144,300.00	0.05
TOPLAM	1,000,000.00	1,144,300.00	0.05
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	2,329,640,978.67
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	132,502.47
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	11,744,565.64
FON TOPLAM DEĞERİ	:	2,316,857,822.50

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	5,702,303.03
37002 Denetim Ücreti	872.10
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	10,844.40
370034 Yabancı Menkul Komisyonu	1,535.31
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	367,423.46
37006 Saklama Giderleri	27,659.29
37008 Banka Masrafları	12.08
37010 Kap Gideri	326.70
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	161.21
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	44,737.85
37023 VIOP İşlemi Komisyonu	96,304.26
37028 Portföy Saklama Hizmeti	5,152.00
37098 Küsürat farkları	0.34
37099 Diğer Giderler	294.30
Toplam	6,257,626.33

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

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

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR

:

8- İTFALAR

:

Menkul Kıymet Türü
T050620

İtfa Tarihi
05.06.2020

Nominal
160000.00

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