

YKP
(YHT) YAPI KREDİ PORTFOY KISA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
EYLÜL 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	:	643,097,134.28
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	8,062,678,171.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	31.07.2002
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER TL

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.079762
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.079272
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	0.62%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	5.67%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	8.99%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		20.81%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		64.37%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		0.22%
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		7.70%
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		1.26%
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	4.31%
Vadeli_YP	0.00%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	0.00%
Katılma Belgesi YP	0.00%
Katılım Hesabı	1.33%
CC Swap	0.00%
FX Swap	0.00%
IR Swap	0.00%
CD Swap	0.00%
VDMK	0.00%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 17.30%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	53.26%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 86.119
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 465,011,122.24
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	: 553,903,391.65

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT071020T23	42,500,000.00	42,430,300.00	6.58
TRT170221T12	50,000,000.00	50,546,500.00	7.84
TRT201021T25	500,000.00	536,090.00	0.08
TRT220921T18	13,000,000.00	12,663,170.00	1.96
TOPLAM	106,000,000.00	106,176,060.00	16.47
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFAKBK12148	6,400,000.00	6,199,360.00	0.96
TRFAKBK121B7	10,000,000.00	10,073,200.00	1.56
TRFAKBK22139	10,000,000.00	9,626,600.00	1.49
TRFAKBKA2026	5,190,000.00	5,090,196.30	0.79
TRFAKYMK2025	15,000,000.00	14,680,350.00	2.28
TRFDNFKE2022	20,000,000.00	19,962,400.00	3.10
TRFFFKR12127	5,000,000.00	4,824,650.00	0.75
TRFFNBKE2024	18,500,000.00	18,466,330.00	2.87

TRFFNBKE2040	10,000,000.00	9,931,400.00	1.54
TRFGRANE2027	30,000,000.00	30,059,700.00	4.66
TRFGRFA12118	5,000,000.00	4,872,350.00	0.76
TRFGRFK12117	5,000,000.00	4,809,850.00	0.75
TRFHLFKE2012	5,500,000.00	5,500,000.00	0.85
TRFISFA12112	9,000,000.00	8,682,210.00	1.35
TRFISFNA2015	10,000,000.00	9,765,500.00	1.52
TRFKCTF42119	18,820,000.00	17,890,856.60	2.78
TRFKFTF52111	7,500,000.00	6,970,800.00	1.08
TRFMCBF32114	8,000,000.00	7,521,920.00	1.17
TRFMCBFK2019	7,000,000.00	6,923,560.00	1.07
TRFTCZBK2018	7,000,000.00	7,046,410.00	1.09
TRFTEBK32115	15,000,000.00	15,103,650.00	2.34
TRFTEBK32131	3,000,000.00	3,009,960.00	0.47
TRFTEBK42114	5,000,000.00	4,952,150.00	0.77
TRFTEBK42122	20,000,000.00	20,110,200.00	3.12
TRFTEBK42130	10,000,000.00	10,036,700.00	1.56
TRFVKFBA2069	6,000,000.00	5,870,220.00	0.91
TRFVKFBA2077	4,000,000.00	3,912,080.00	0.61
TRFVKFBE2057	13,000,000.00	12,933,960.00	2.01
TRFVKFBK2059	20,000,000.00	20,298,200.00	3.15
TRFYAKFA2026	3,000,000.00	2,914,350.00	0.45
TRFYKBK12114	10,000,000.00	9,744,800.00	1.51
TRFYKBK12148	12,000,000.00	12,035,040.00	1.87
TRFYKBKA2010	12,000,000.00	12,101,640.00	1.88
TRFYKBKA2036	5,000,000.00	5,029,250.00	0.78
TRFYKBKE2032	5,000,000.00	4,974,250.00	0.77
TOPLAM	355,910,000.00	351,924,092.90	54.60
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSARCL22117	3,000,000.00	3,045,120.00	0.47
TRSARCL72112	9,010,000.00	9,224,438.00	1.43
TRSDZBK12226	30,000,000.00	26,372,400.00	4.09
TRISISGY32111	4,550,000.00	4,581,076.50	0.71
TRSKFTFA2114	10,000,000.00	10,277,900.00	1.59
TRSOPAS22111	9,400,000.00	9,600,596.00	1.49
TRSOTKO32110	5,000,000.00	5,031,000.00	0.78
TRSOTKO72116	9,500,000.00	9,616,850.00	1.49
TRSTISB72712	5,000,000.00	5,130,050.00	0.80
TRSVKFB92719	5,000,000.00	5,364,300.00	0.83
TOPLAM	90,460,000.00	88,243,730.50	13.69
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
TRD100221T17	110,000.00	114,973.10	0.02
TRD100822T10	160,000.00	156,944.00	0.02
TRD140721T18	140,000.00	140,047.60	0.02
TRD151221T10	760,000.00	775,526.80	0.12
TRD160621T17	80,000.00	89,578.40	0.01
TRD260122T19	280,000.00	274,316.00	0.04

TOPLAM		1,530,000.00	1,551,385.90	0.24
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
TRT071020T23		5,010.00	5,000.93	0.00
TRT071020T23		45,586,616.00	45,514,796.85	7.06
TRT230222T13		4,269,675.00	10,003,287.67	1.55
TOPLAM		49,861,301.00	55,523,085.45	8.61
L) DİĞER	:			
Katılım Hesabı gün 35		10,000,000.00	10,098,567.36	1.57
Vadeli Mevduat gün 94		10,203,874.13	10,378,326.54	1.61
Vadeli Mevduat gün 94		5,540,258.42	5,626,186.96	0.87
BPP		5,012,417.81	5,001,862.31	0.78
BPP		5,014,191.78	5,001,800.47	0.78
BPP		5,021,287.67	5,001,875.59	0.78
TOPLAM			41,108,619.23	6.38
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	:	644,526,973.98		
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	13,705.22		
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00		
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00		
E. BORÇLAR (-)	:	1,443,544.92		
FON TOPLAM DEĞERİ	:	643,097,134.28		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	:			
Açıklama		Tutarı		
37001 Fon Yönetim Ücreti		1,367,272.81		
37002 Denetim Ücreti		871.80		
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı		3,363.93		
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı		15,657.42		
37005 Vergi, Resim ve Harçlar		58.80		
37006 Saklama Giderleri		16,144.38		
37008 Banka Masrafları		821.97		
37010 Kap Gideri		477.30		
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu		1,050.00		
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti		2,750.43		
37028 Portföy Saklama Hizmeti		4,508.00		
37098 Küsurat farkları		0.47		
37099 Diğer Giderler		294.30		

Toplam 1,413,271.61

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
TRFVKFB92013	01.09.2020	10000000.00
TRDHVKA92016	01.09.2020	2470000.00
TRFFNBK92028	04.09.2020	5000000.00
TRFVKFB92039	04.09.2020	6700000.00
TRFTCZB92012	10.09.2020	9000000.00
TRT160920T25	16.09.2020	1000000.00
TRFYKYM92023	16.09.2020	4500000.00
TRFDZBK92043	25.09.2020	20000000.00
TRFISFA92015	25.09.2020	5260000.00
TRFAKYM92015	28.09.2020	20000000.00

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