

YKP
(YDP) YAPI KREDİ PORTFOY PY ÜÇÜNCÜ DEĞİSKEN ÖZEL FON
EYLÜL 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	:	1,003,072,164.30
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	35,471,417,836.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	20.07.2012
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER TL

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.028278
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.027829
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.61%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	10.49%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	16.60%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		6.66%
Devlet Tahvili		49.92%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		13.73%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		3.46%
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		8.31%
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)		0.00%

Yabancı Hisse Senetleri	0.00%
VIOP Nakit Teminat	0.82%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	6.25%
Vadeli_YP	0.00%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	10.65%
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	0.18%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 70.79%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	8.88%
Devlet Borçlanma Senetleri	30.72%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 395.086
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 15,999,999.98
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	2,378,200.00	0.24
AKBNK	550,000.00	2,832,500.00	0.28
ALARK	100,000.00	601,000.00	0.06
ARCLK	150,000.00	3,720,000.00	0.37
BIMAS	99,500.00	6,925,200.00	0.69
CCOLA	51,000.00	2,284,800.00	0.23
DOHOL	750,000.00	1,777,500.00	0.18
ENKAI	0.61	4.28	0.00
EREGL	705,009.00	6,669,385.14	0.67
GARAN	725,000.00	5,147,500.00	0.52
HALKB	350,000.00	1,795,500.00	0.18
ISCTR	625,000.00	3,343,750.00	0.33
ISDMR	100,000.00	719,000.00	0.07
ISGYO	1.08	1.88	0.00
ISMEN	290,000.00	2,714,400.00	0.27
KCHOL	210,000.00	3,080,700.00	0.31
MGROS	55,000.00	2,266,000.00	0.23
ODAS	1.18	3.36	0.00
OTKAR	16,000.00	2,204,800.00	0.22

SAHOL	125,000.00	1,040,000.00	0.10
SISE	375,000.53	2,745,003.89	0.27
SODA	285,000.02	2,365,500.14	0.24
TCELL	350,000.00	5,320,000.00	0.53
TKFEN	1.00	14.82	0.00
TOASO	61,500.00	1,512,900.00	0.15
TTKOM	600,000.00	4,284,000.00	0.43
TUPRS	42,000.00	3,343,200.00	0.33
VAKBN	1.00	4.14	0.00
YATAS	150,000.00	1,335,000.00	0.13
YKBNK	1,000,000.32	2,130,000.68	0.21
TOPLAM	7,880,014.74	72,535,868.34	7.26
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI	:		
TRT080328T15	100,000.00	98,111.00	0.01
TRT090621T18	45,000,000.00	41,597,550.00	4.17
TRT110226T13	13,000,000.00	12,090,000.00	1.21
TRT110827T16	45,769,000.00	41,547,267.44	4.16
TRT120325T12	20,000.00	16,867.40	0.00
TRT140623T19	300,000.00	334,521.00	0.03
TRT170221T12	33,800,000.00	34,169,434.00	3.42
TRT170822T15	6,100,000.00	5,957,809.00	0.60
TRT180123T10	200,000.00	202,462.00	0.02
TRT200324T13	67,000.00	62,604.13	0.01
TRT201021T25	29,000,000.00	31,093,220.00	3.11
TRT210421T14	12,000,000.00	13,682,520.00	1.37
TRT220921T18	257,700,000.00	251,022,993.00	25.13
TRT240724T15	22,000.00	19,907.58	0.00
TRT261022T10	500,000.00	1,152,320.00	0.12
TOPLAM	443,578,000.00	433,047,586.55	43.36
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
TRT110226T13	-5,000,000.00	-4,646,150.00	-0.47
TOPLAM	-5,000,000.00	-4,646,150.00	-0.47
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ	:		
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)	:		
E) DÖVİZE ENDEKSİLİ TAHVİLLER	:		
TRT160721F14	260,000.00	2,018,978.32	0.20
TRT171221F16	2,770,000.00	24,938,869.15	2.50
TRT280521F12	630,000.00	4,966,716.71	0.50
TRT280521F20	10,000.00	92,069.45	0.01
TOPLAM	3,670,000.00	32,016,633.62	3.21
F) FİNANSMAN BONOLARI	:		
TRFKCTF42119	10,000,000.00	9,506,300.00	0.95
TRFTEBK42114	10,000,000.00	9,904,300.00	0.99
TRFYKBKA2028	15,000,000.00	15,159,900.00	1.52
TOPLAM	35,000,000.00	34,570,500.00	3.46
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSARCL22117	11,030,000.00	11,195,891.20	1.12
TRSARCL72112	8,410,000.00	8,610,158.00	0.86

TR SAYGZ62110	2,800,000.00	2,832,536.00	0.28
TR SENSEA72211	5,100,000.00	7,963,752.00	0.80
TR SERGL52117	2,900,000.00	2,934,568.00	0.29
TR SGRAN23013	4,900,000.00	5,122,215.00	0.51
TR SKCTFA2117	10,000,000.00	10,257,800.00	1.03
TR SKFTF62113	1,360,000.00	1,370,118.40	0.14
TR SKRSNE2018	2,000,000.00	2,065,320.00	0.21
TR SOPAS22111	1,000,000.00	1,021,340.00	0.10
TR SOPAS22129	4,600,000.00	4,674,612.00	0.47
TR SOTKO32110	8,000,000.00	8,049,600.00	0.81
TR STHALE2716	500,000.00	503,170.00	0.05
TR STISB72712	5,140,000.00	5,273,691.40	0.53
TR STISB92918	8,000,000.00	8,001,040.00	0.80
TR STPRS12115	4,000,000.00	4,054,560.00	0.41
TR SVKFB92719	2,170,000.00	2,328,106.20	0.23
TR SYKBK62914	6,300,000.00	6,424,866.00	0.64
TR SYKBK92911	10,000,000.00	10,255,300.00	1.03
TOPLAM	98,210,000.00	102,938,644.20	10.31
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
TR D100822T10	10,000,000.00	9,809,000.00	0.98
TR D260122T19	24,750,000.00	24,247,575.00	2.43
TOPLAM	34,750,000.00	34,056,575.00	3.41
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TR T061124T11	17,373,770.00	20,006,575.34	2.00
TR T080323T10	20,462,125.00	17,505,753.42	1.75
TR T080328T15	3,699,995.00	3,501,150.68	0.35
TR T081123T10	5,580,125.00	12,003,945.21	1.20
TR T090621T18	4,464,960.00	4,001,315.07	0.40
TR T160425T33	33,341,600.00	33,010,849.32	3.31
TR T170724T14	3,553,460.00	3,501,150.68	0.35
TR T260122T11	6,587,515.00	6,502,136.99	0.65
TR T290125T15	12,823,390.00	13,504,438.36	1.35
TOPLAM	107,886,940.00	113,537,315.07	11.37
L) DİĞER	:		
GLDTRF	1,869,877.00	77,469,004.11	7.76
ZGOLDf	520,000.00	24,336,000.00	2.44
YPF	1,094,719.00	2,112,046.84	0.21
YSF	1,235,967.00	1,307,382.41	0.13
YPL	400,000.00	3,417,127.48	0.34
Vadeli Mevduat gün 35	15,445,286.94	15,611,967.63	1.56
Vadeli Mevduat gün 35	15,466,611.05	15,636,138.27	1.57
Vadeli Mevduat gün 35	15,279,962.75	15,441,628.33	1.55
Vadeli Mevduat gün 35	15,152,049.18	15,241,502.07	1.53
F_XAUUSD1020	300.00	4,417,358.60	

BPP		348,121.08	348,121.08	0.03
TOPLAM			170,920,918.21	17.11
M) VARANT	:			
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:			
		8,022,432.54	8,022,432.54	0.80
TOPLAM		8,022,432.54	8,022,432.54	0.80
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
O) VDMK	:			
TRPTYV232410		1,500,000.00	1,705,680.00	0.17
TOPLAM		1,500,000.00	1,705,680.00	0.17
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU	:			
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	998,706,003.54		
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	5,759.90		
C. ALACAKLAR (+)	:	5,993,896.80		
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00		
E. BORÇLAR (-)	:	1,633,495.94		
FON TOPLAM DEĞERİ	:	1,003,072,164.30		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER	:			
Açıklama			Tutarı	
37001 Fon Yönetim Ücreti		163,756.00		
37002 Denetim Ücreti		872.10		
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı		2,127.24		
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı		21,033.60		
370034 Yabancı Menkul Komisyonu		139.17		
37004 Aracılık Komisyonu		4,435.05		
37005 Vergi, Resim ve Harçlar		58.80		
37006 Saklama Giderleri		10,448.67		
37008 Banka Masrafları		421.74		
37010 Kap Gideri		477.30		
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu		188.06		
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti		18,921.94		
37028 Portföy Saklama Hizmeti		4,508.00		
37098 Küsürat farkları		0.60		
37099 Diğer Giderler		294.30		
Toplam		227,682.57		
6- GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI, BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI, TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR	:			
Açıklama		Giriş Tarihi	Stok	Kazanılan Nominal
TKFEN Tem :%38.42		24.09.2020	1.00	0.38
7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR	:			

8- İTFALAR	:				
Menkul Kıymet Türü		İtfa Tarihi	Nominal		
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