

YKP**(YBP) YAPI KREDİ PORTFOY PY BİRİNCİ DEĞİŞKEN ÖZEL FON****EYLÜL 2020 AYLIK RAPORUDUR.****1- FONU TANITICI BİLGİLER**

A. FONUN ADI	:	(YBP) YAPI KREDİ PORTFOY PY BİRİNCİ DEĞİŞKEN ÖZEL FON
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	30,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	206,554,408.14
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	129,877,750.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	10.08.1998
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER TL

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	1.590376
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	1.544965
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	2.94%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	13.62%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	21.71%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		20.85%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		13.67%
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		14.65%
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		0.13%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		35.01%

Yabancı Hisse Senetleri	0.00%
VIOP Nakit Teminat	0.00%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	7.33%
Vadeli_YP	0.00%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	8.35%
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	0.26%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	104.09%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	1062.481
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			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT110226T13	11,500,000.00	10,695,000.00	4.67
TRT110827T16	69,000.00	62,635.44	0.03
TRT140922T17	14,000.00	13,049.26	0.01
TRT240724T15	27,000.00	24,432.03	0.01
TRT270923T11	10,000.00	8,954.00	0.00
TOPLAM	11,620,000.00	10,804,070.73	4.72
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
TRT110226T13	23,500,000.00	21,869,105.00	9.56
TOPLAM	23,500,000.00	21,869,105.00	9.56
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSİLİ TAHVİLLER			
TRT171221F16	900,000.00	8,102,881.67	3.54
TOPLAM	900,000.00	8,102,881.67	3.54
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFYKBK12122	1,600,000.00	1,543,504.00	0.67
TOPLAM	1,600,000.00	1,543,504.00	0.67
VALÖRLÜ İŞLEMLER			

G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:			
TRSAKYP41612		428,128.00	450,138.06	0.20
TRSARCL22117		6,210,000.00	6,303,398.40	2.75
TRSARCL72112		4,940,000.00	5,057,572.00	2.21
TRSIGY32111		910,000.00	916,215.30	0.40
TRSKFTF62113		640,000.00	644,761.60	0.28
TRSOPAS22129		1,100,000.00	1,117,842.00	0.49
TRSTISB72712		1,580,000.00	1,621,095.80	0.71
TRSTISB92918		3,000,000.00	3,000,390.00	1.31
TRSVKFB92719		2,080,000.00	2,231,548.80	0.98
TRSYKBK62914		1,800,000.00	1,835,676.00	0.80
TRSYKBK92911		3,000,000.00	3,076,590.00	1.34
TOPLAM		25,688,128.00	26,255,227.96	11.47
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
H) KİRA SERTİFİKALARI	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
US900123AL40		1100000.00	11399199.23	4.98
US900123AW05		250000.00	2027384.41	0.89
US900123BH29		362000.00	2824004.13	1.23
US900123BJ84		300000.00	1960508.12	0.86
US900123BY51		2500000.00	19358600.04	8.46
US900123BZ27		1500000.00	11760397.49	5.14
US900123CJ75		1400000.00	10031773.17	4.38
US900123CL22		1000000.00	7446608.28	3.25
US900123CM05		1450000.00	9147504.91	4.00
US900123CR91		1500000.00	12233262.31	5.35
TOPLAM		11,362,000.00	88,189,242.09	38.54
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
TRT090621T18		22,324,785.00	20,006,575.34	8.74
TRT111120T18		12,432,255.00	12,504,109.59	5.46
TRT180123T10		5,636,235.00	5,501,808.22	2.40
TOPLAM		40,393,275.00	38,012,493.15	16.61
L) DİĞER	:			
YAY		22,038.00	2,725,330.06	1.19
YBE		9,205,454.00	1,940,656.99	0.85
YBS		463,301,019.00	11,745,607.43	5.13
YHS		391,125.00	612,882.71	0.27
YPL		191,985.00	1,640,093.05	0.72
Vadeli Mevduat gün 35		3,712,435.59	3,752,499.03	1.64
Vadeli Mevduat gün 35		3,718,622.25	3,759,381.51	1.64
Vadeli Mevduat gün 35		3,710,983.66	3,750,246.74	1.64
Vadeli Mevduat gün 40		3,705,592.81	3,751,122.42	1.64
BPP		361,125.61	361,125.61	0.16
TOPLAM			34,038,945.55	14.88
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	:	228,815,470.15
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	85,212.71
C. ALACAKLAR (+)	:	10,696,577.70
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	32,592,714.36
FON TOPLAM DEĞERİ	:	206,554,408.14

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER :

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	16,738.65
37002 Denetim Ücreti	871.80
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	1,052.71
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	7,824.60
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	58.80
37006 Saklama Giderleri	5,261.96
37008 Banka Masrafları	60.40
37010 Kap Gideri	477.30
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	190.31
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	3,535.39
37028 Portföy Saklama Hizmeti	3,136.00
37099 Diğer Giderler	294.30
Toplam	39,502.22

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

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

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