

YKP**(YBE) YAPI KREDİ PORTFOY EUROBOND (DOLAR) BORCLANMA ARAÇLARI FONU****EYLÜL 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	:	2,633,328,887.90
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	12,535,844,109.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	29.06.2000
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER TL

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.210064
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.199975
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	5.05%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	22.43%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	33.01%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		3.53%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		0.24%
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		3.39%
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		0.04%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		87.33%

Yabancı Hisse Senetleri	0.00%
VIOP Nakit Teminat	0.71%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	0.00%
Vadeli_YP	4.82%
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	-0.12%
IR Swap	0.00%
CD Swap	0.00%
VDMK	0.04%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 24.86%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	0.80%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 1726.029
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 112,993,355.61
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	: 71,392,430.99

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	2,000,000.00	18,342,129.88	0.69
TRT171221F16	8,240,000.00	74,186,383.33	2.80
TOPLAM	10,240,000.00	92,528,513.21	3.50
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFDGOZ71915	1,056,743.00	1,056,743.00	0.04
TOPLAM	1,056,743.00	1,056,743.00	0.04
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ			
TRSKRSNE2018	400,000.00	413,064.00	0.02
TRSYKBK62914	4,500,000.00	4,589,190.00	0.17
TOPLAM	4,900,000.00	5,002,254.00	0.19
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
H) KİRA SERTİFİKALARI			
VALÖRLÜ İŞLEMLER			

D) YABANCI MENKUL KIYMETLER

US900123AT75	5294000.00	43389284.80	1.64
US900123AW05	14379000.00	116607042.00	4.41
US900123AY60	34568000.00	252299993.81	9.53
US900123BB58	9112000.00	68949090.71	2.61
US900123BG46	7443000.00	53707387.57	2.03
US900123BJ84	3685000.00	24081574.78	0.91
US900123BZ27	5000000.00	39201324.96	1.48
US900123CA66	1000000.00	7372884.85	0.28
US900123CF53	24270000.00	185378267.90	7.01
US900123CG37	5400000.00	37014274.30	1.40
US900123CK49	8400000.00	61189882.10	2.31
US900123CL22	17400000.00	129570984.00	4.90
US900123CM05	1966000.00	12402754.94	0.47
US900123CP36	3800000.00	27034231.56	1.02
US900123CQ19	32600000.00	247353910.67	9.35
US900123CR91	7150000.00	58311883.67	2.20
US900123CT57	9685000.00	79936985.89	3.02
US900123CV04	2000000.00	15630218.21	0.59
US900123CW86	11550000.00	88874881.78	3.36
XS0847042024	3953000.00	30467168.48	1.15
XS0849728190	6654000.00	51229278.47	1.94
XS0861979440	2600000.00	19749481.46	0.75
XS1003016018	2343000.00	18731646.71	0.71
XS1079527211	3690000.00	28941018.87	1.09
XS1376681067	163000.00	1263539.10	0.05
XS1390320981	4926000.00	39157104.63	1.48
XS1508390090	2000000.00	15688902.36	0.59
XS1508914691	4800000.00	37910118.53	1.43
XS1571399754	15763000.00	122092227.39	4.61
XS1578203462	7470000.00	56655495.12	2.14
XS1584113184	141000.00	1019065.49	0.04
XS1605397394	600000.00	4628575.05	0.17
XS1622626379	695000.00	5384896.54	0.20
XS1684378208	11134000.00	82521264.94	3.12
XS1711581337	1500000.00	11216483.76	0.42
XS1750996206	10490000.00	78866322.96	2.98
XS1772360803	2000000.00	14094739.95	0.53
XS1788516679	5200000.00	39487272.61	1.49
XS1814962582	2000000.00	15336099.74	0.58
XS1917720911	400000.00	3210744.18	0.12
XS1970705528	1000000.00	7810263.98	0.30
XS2100270508	5700000.00	41685641.49	1.58
XS2131335270	2500000.00	19103649.56	0.72
TOPLAM	302,424,000.00	2,294,557,859.83	86.72

İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER

J) REPO

K) TERS REPO

TRT070727T13	4,768,320.00	7,502,465.75	0.28
--------------	--------------	--------------	------

TRT080323T10	79,510,005.00	68,022,356.17	2.57
TRT111120T18	24,864,510.00	25,008,219.18	0.95
TRT180625T13	7,594,050.00	7,502,465.75	0.28
TOPLAM	116,736,885.00	108,035,506.85	4.08
L) DİĞER :			
FX Swap YBE-2312/EURUSD	13,000,000.00	1,055,202.94	0.04
Vadeli Mevduat YP gün 1	2,075,000.00	16,085,902.91	0.61
Vadeli Mevduat YP gün 1	5,000,040.98	38,761,476.53	1.46
Vadeli Mevduat YP gün 7	8,871,987.47	68,784,749.42	2.60
BPP	480,165.04	480,165.04	0.02
TOPLAM		125,167,496.84	4.73
M) VARANT :			
N) VIOP NAKİT TEMİNAT :			
	18,562,016.16	18,562,016.16	0.70
TOPLAM	18,562,016.16	18,562,016.16	0.70
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER :			
VALÖRLÜ İŞLEMLER :			
O) VDMK :			
TRPTYV232410	1,000,000.00	1,137,120.00	0.04
TOPLAM	1,000,000.00	1,137,120.00	0.04
VALÖRLÜ İŞLEMLER :			

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU :

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	2,646,047,509.88
B. HAZİR DEĞERLER (+)	188,302.32
C. ALACAKLAR (+)	0.00
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	0.00
E. BORÇLAR (-)	11,850,181.30
FON TOPLAM DEĞERİ	2,633,328,887.90

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER :

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	6,295,290.87
37002 Denetim Ücreti	872.10
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	21,991.20
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	58.80
37006 Saklama Giderleri	31,226.08
37008 Banka Masrafları	101.68
37010 Kap Gideri	477.30
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	850.09
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	49,280.16
37023 VIOP İşlemi Komisyonu	34,166.73
37028 Portföy Saklama Hizmeti	4,508.00
37099 Diğer Giderler	294.30
Toplam	6,439,117.31

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