

YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
(YBP) YAPI KREDİ PORTFÖY PY BİRİNCİ DEĞİŞKEN ÖZEL FON
MART 2021 AYLIK RAPORUDUR.

I- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	(YBP) YAPI KREDİ PORTFÖY PY BİRİNCİ DEĞİŞKEN ÖZEL FON
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
Ç. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	210,609,439.21
D. KATILMA PAYI SAYISI	:	129,865,850.00
E. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	10.08.1998
F. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

II- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER TL

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	1.621746
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	1.664563
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	-2.57%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	-2.67%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	15.41%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ	:	
MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Devlet Tahvili	:	27.37%
Özel Sektör Tahvili	:	17.58%
Devlet Tahvili Ters Repo	:	2.62%
Takasbank Para Piyasası	:	0.26%
Dış Borçlanma Araçları (Eurobondlar)	:	35.81%
Vadeli Mevduat	:	7.59%
Yatırım Fonu Katılma Payı	:	8.77%
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:	13.71%
G. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	:	1469.115
Ğ. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	:	0.00
H. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	:	0.00

III- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Isin Kodu	Vade	İhraççı	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZINE BONOLARI						

TRT110827T16	TRT110827T16	11.08.2027	Hazine ve Maliye Bakanlığı	10,069,000.00	7,172,652.15	3.46
TRT131130T14	TRT131130T14	13.11.2030	Hazine ve Maliye Bakanlığı	26,000,000.00	19,293,560.00	9.30
TRT140922T17	TRT140922T17	14.09.2022	Hazine ve Maliye Bakanlığı	14,000.00	12,441.66	0.01
TRT180123T10	TRT180123T10	18.01.2023	Hazine ve Maliye Bakanlığı	15,000,000.00	14,016,150.00	6.75
TRT240724T15	TRT240724T15	24.07.2024	Hazine ve Maliye Bakanlığı	27,000.00	21,220.92	0.01
TRT270923T11	TRT270923T11	27.09.2023	Hazine ve Maliye Bakanlığı	10,000.00	8,179.10	0.00
TOPLAM				51,120,000.00	40,524,203.83	19.53
E) FİNANSMAN BONOLARI						
TRFHSBC52115	TRFHSBC52115	05.05.2021	HSBC	2,070,000.00	2,040,792.30	0.98
TRFYKKBK42145	TRFYKKBK42145	30.04.2021	YAPIKREDIBANK	1,600,000.00	1,606,704.00	0.77
TOPLAM				3,670,000.00	3,647,496.30	1.76
F) ÖZEL SEKTÖR TAHHİLLERİ						
TRSAKYP41612	TRSAKYP41612	26.04.2021	AKYUREKPAZARLAMA	428,128.00	450,138.06	0.22
TRSARCL22315	TRSARCL22315	10.02.2023	ARCELİK	6,500,000.00	6,656,585.00	3.21
TRSARCL72112	TRSARCL72112	16.07.2021	ARCELİK	4,940,000.00	5,118,087.00	2.47
TRSKFTF62113	TRSKFTF62113	10.06.2021	KOCFIAT	640,000.00	646,860.80	0.31
TRSOPAS22319	TRSOPAS22319	17.02.2023	OPET	1,500,000.00	1,532,085.00	0.74
TRSTHALE2716	TRSTHALE2716	22.10.2027	THALKBANKASI	500,000.00	507,330.00	0.24
TRSTISB72712	TRSTISB72712	27.07.2027	ISBANK_C	1,580,000.00	1,623,702.80	0.78
TRSTISB92918	TRSTISB92918	13.09.2029	ISBANK_C	3,000,000.00	3,072,300.00	1.48
TRSTPRSK2217	TRSTPRSK2217	28.11.2022	TUPRAS	4,000,000.00	4,057,520.00	1.96
TRSTTLK12216	TRSTTLK12216	20.01.2022	TURKTELEKOM	2,150,000.00	2,163,050.50	1.04
TRSVKFB92719	TRSVKFB92719	06.09.2027	VAKIFBANK	2,080,000.00	2,247,356.80	1.08
TRSYKKBK62914	TRSYKKBK62914	20.06.2029	YAPIKREDIBANK	1,800,000.00	1,941,858.00	0.94
TRSYKKBK92911	TRSYKKBK92911	20.09.2029	YAPIKREDIBANK	3,000,000.00	3,134,190.00	1.51
TOPLAM				32,118,128.00	33,151,063.96	15.98
J) DIŞ BORÇLANMA ARAÇLARI(EUROBONDLAR)						
US900123AL40	US900123AL40	15.01.2030	Hazine ve Maliye Bakanlığı	1,100,000.00	12,078,346.30	5.82
US900123AW05	US900123AW05	05.02.2025	Hazine ve Maliye Bakanlığı	250,000.00	2,173,866.38	1.05
US900123BJ84	US900123BJ84	14.01.2041	Hazine ve Maliye Bakanlığı	300,000.00	2,128,748.87	1.03
US900123BY51	US900123BY51	25.03.2022	Hazine ve Maliye Bakanlığı	1,000,000.00	8,377,419.96	4.04
US900123CJ75	US900123CJ75	14.04.2026	Hazine ve Maliye Bakanlığı	1,400,000.00	10,806,388.85	5.21
US900123CL22	US900123CL22	25.03.2027	Hazine ve Maliye Bakanlığı	1,000,000.00	7,984,275.68	3.85
US900123CM05	US900123CM05	11.05.2047	Hazine ve Maliye Bakanlığı	1,450,000.00	10,031,025.83	4.83
US900123CR91	US900123CR91	23.12.2023	Hazine ve Maliye Bakanlığı	1,500,000.00	13,140,735.03	6.33
US900123DC14	US900123DC14	26.06.2031	Hazine ve Maliye Bakanlığı	1,250,000.00	9,492,556.80	4.57
TOPLAM				9,250,000.00	76,213,363.70	36.73
N) TERS REPO						
TRT140126T37	TRT140126T37	01.04.2021	Hazine ve Maliye Bakanlığı	17,368,380.00	17,008,849.32	8.20
TOPLAM				17,368,380.00	17,008,849.32	8.20
O) TAKASBANK PARA PİYASASI						
BPP		01.04.2021		40,021.04	40,021.04	0.02
TOPLAM					40,021.04	0.02
Ö) VADELİ MEVDUAT						

Vadeli Mevduat gün 42	10.05.2021	Akbank	4,050,227.20	4,056,488.90	1.95
Vadeli Mevduat gün 42	10.05.2021	Türkiye Vakıflar Bankası	4,055,149.27	4,061,581.83	1.96
Vadeli Mevduat gün 42	10.05.2021	Türkiye Halk Bankası	4,065,344.72	4,071,793.46	1.96
Vadeli Mevduat gün 42	10.05.2021	Yapı ve Kredi Bankası	4,047,184.88	4,053,360.38	1.95
TOPLAM				16,243,224.57	7.83
§) YATIRIM FONU KATILMA PAYI					
YAY		YAPI KREDİ PORTFÖY YABANCI TEKNOLOJİ SEKTÖRÜ HİSSE SENEDİ FONU	22,038.00	3,370,535.97	1.62
YBE		YAPI KREDİ PORTFÖY EURO BOND (DOLAR) BORÇLANMA ARAÇLARI FONU	9,205,454.00	2,141,114.96	1.03
YBS		YAPI KREDİ PORTFÖY ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI FONU	463,301,019.00	12,617,539.95	6.08
YHS		YAPI KREDİ PORTFÖY BİRİNCİ HİSSE SENEDİ FONU (HİSSE SENEDİ YOĞUN FON)	391,125.00	766,294.84	0.37
YPL		YAPI KREDİ PORTFÖY BALAT SERBEST (DÖVİZ) FON	191,985.00	1,782,268.45	0.86
TOPLAM				20,677,754.17	9.96

IV- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	207,505,976.88
B. HAZİR DEĞERLER (+)	3,570,375.51
C. ALACAKLAR (+)	25,364.35
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	0.00
E. BORÇLAR (-)	42,139.47
FON TOPLAM DEĞERİ	210,609,439.21

V- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	18,153.56
37002 Denetim Ücreti	983.66
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	821.23
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	1,275.81
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	64.10
37006 Saklama Giderleri	4,785.40
37008 Banka Masrafları	204.83
37010 Kap Gideri	493.21
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	290.43
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	3,469.50
37028 Portföy Saklama Hizmeti	4,158.00
37099 Diğer Giderler	335.42
Toplam	35,035.15

VI-A-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI

08/04/2021 12:33:51

KULLANIMI, BEDELSİZ
HISSE SENEDİ ALIMI,
TEMETTÜ VE ANAPARA
TAHSİLATINA

İLİŞKİN AÇIKLAMALAR

Açıklama	Giriş Tarihi	Stok	Kazanılan Nominal
B- GEÇEN AY İÇİNDE YATIRIM FONLARINA İLİŞKİN MEVZUATTA MEYDANA GELEN DEĞİŞME VE HUKUKİ İHTİLAFLARLA İLGİLİ AÇIKLAMALAR:			

VII- PORTFÖYDEN SATIŞLAR

Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Satış Tarihi	Vade	Nominal	Satış Değeri
Takasbank Para Piyasası		01.03.2021	02.03.2021	619,000.00	619,000.00
Takasbank Para Piyasası		02.03.2021	03.03.2021	630,000.00	630,000.00
Takasbank Para Piyasası		03.03.2021	04.03.2021	644,000.00	644,000.00
Takasbank Para Piyasası		04.03.2021	05.03.2021	648,000.00	648,000.00
Takasbank Para Piyasası		05.03.2021	08.03.2021	266,000.00	266,000.00
Takasbank Para Piyasası		08.03.2021	09.03.2021	635,000.00	635,000.00
Takasbank Para Piyasası		09.03.2021	10.03.2021	343,000.00	343,000.00
Takasbank Para Piyasası		10.03.2021	11.03.2021	339,000.00	339,000.00
Takasbank Para Piyasası		11.03.2021	12.03.2021	367,000.00	367,000.00
Takasbank Para Piyasası		12.03.2021	15.03.2021	368,000.00	368,000.00
Takasbank Para Piyasası		15.03.2021	16.03.2021	555,000.00	555,000.00
Takasbank Para Piyasası		16.03.2021	17.03.2021	556,000.00	556,000.00
Takasbank Para Piyasası		17.03.2021	18.03.2021	557,000.00	557,000.00
Takasbank Para Piyasası		18.03.2021	19.03.2021	558,000.00	558,000.00
Takasbank Para Piyasası		19.03.2021	22.03.2021	1,145,000.00	1,145,000.00
Takasbank Para Piyasası		22.03.2021	23.03.2021	567,000.00	567,000.00
Takasbank Para Piyasası		23.03.2021	24.03.2021	515,000.00	515,000.00
Takasbank Para Piyasası		24.03.2021	25.03.2021	517,000.00	517,000.00
Takasbank Para Piyasası		25.03.2021	26.03.2021	637,000.00	637,000.00
Takasbank Para Piyasası		26.03.2021	29.03.2021	668,000.00	668,000.00
Takasbank Para Piyasası		29.03.2021	30.03.2021	675,000.00	675,000.00
Takasbank Para Piyasası		30.03.2021	31.03.2021	677,000.00	677,000.00
Takasbank Para Piyasası		31.03.2021	01.04.2021	40,000.00	40,000.00
Devlet Tahvili	TRT131130T14	05.03.2021	13.11.2030	10,000,000.00	9,366,071.42
Devlet Tahvili	TRT110827T16	19.03.2021	11.08.2027	10,000,000.00	8,586,538.46
Devlet Tahvili	TRT131130T14	30.03.2021	13.11.2030	10,000,000.00	7,375,000.00
Devlet Tahvili	TRT131130T14	30.03.2021	13.11.2030	8,000,000.00	5,908,000.00

VIII- İTFALAR

Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	İtf Tarih	Nominal
TRISGY32111	ISGMYO	23.03.2021	910000.00
T300321	TCHAZINEMUSTESARLIGI	30.03.2021	362000.00

IX- PORTFÖYE ALIŞLAR

Menkul Kıymet Türü	İhraççı Kurum	Alış Tarihi	Vade	Nominal	Alış Değeri
Devlet Tahvili	TRT131130T14	04.03.2021	13.11.2030	12,000,000.00	11,389,714.29
Devlet Tahvili	TRT131130T14	08.03.2021	13.11.2030	10,000,000.00	9,294,285.72
Devlet Tahvili	TRT110827T16	19.03.2021	11.08.2027	10,000,000.00	8,595,192.31
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT020823T11	01.03.2021	02.03.2021	3,933,955.00	9,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT280628T18	01.03.2021	02.03.2021	2,657,505.00	4,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT120325T12	02.03.2021	03.03.2021	15,399,075.00	13,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT110226T13	03.03.2021	04.03.2021	4,547,795.00	4,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT230222T13	03.03.2021	04.03.2021	3,632,700.00	9,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT220921T18	04.03.2021	05.03.2021	13,323,105.00	13,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT050624T35	05.03.2021	08.03.2021	1,547,210.00	2,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT220921T18	08.03.2021	09.03.2021	11,269,950.00	11,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT270923T11	09.03.2021	10.03.2021	2,263,190.00	2,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT120128T11	10.03.2021	11.03.2021	1,289,825.00	2,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT210623T10	11.03.2021	12.03.2021	1,984,910.00	2,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT230222T13	12.03.2021	15.03.2021	806,270.00	2,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT120325T12	15.03.2021	16.03.2021	2,434,855.00	2,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT210623T10	16.03.2021	17.03.2021	1,980,360.00	2,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT210623T10	17.03.2021	18.03.2021	1,977,620.00	2,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT120128T11	18.03.2021	19.03.2021	1,270,880.00	2,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT140126T37	19.03.2021	22.03.2021	10,125,990.00	10,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT240724T15	22.03.2021	23.03.2021	2,404,515.00	2,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT100124T17	23.03.2021	24.03.2021	2,246,285.00	3,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT070727T13	24.03.2021	25.03.2021	1,812,065.00	3,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT070727T13	25.03.2021	26.03.2021	1,810,985.00	3,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT120325T12	26.03.2021	29.03.2021	4,275,675.00	3,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT030523T13	29.03.2021	30.03.2021	1,335,895.00	3,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT230222T13	30.03.2021	31.03.2021	1,204,055.00	3,000,000.00
Devlet Tahvili Ters Repo	TRT140126T37	31.03.2021	01.04.2021	17,368,380.00	17,000,000.00
Vadeli Mevduat		29.03.2021	10.05.2021	16,217,906.07	16,217,906.07