YKP

(YBS) YAPI KREDI PORTFOY OZEL SEKTOR BORCLANMA ARACLARI FONU

MART 2019 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	**(YBS) YAPI KREDI PORTFOY OZEL SEKTOR BORCLANMA ARACLARI FONU**
B. KURUCUNUN UNVANI	:	**YKP**
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	**YAPI KREDI PORTFOY YONETIMI A.S.**
Ç. FON TUTARI	:	600,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	345,077,387.04
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	16,658,762,295.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	25.01.2012
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.020714
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.020372
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	1.68%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	4.87%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	18.37%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		0.04%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		79.45%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		1.18%
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%
Devlet Tahvili Ters Repo		14.24%
Özel Sek. Tahvili Ters Repo		0.00%
Kuponlar Ters Repo		0.00%
Hazine Bonosu Ters Repo		0.00%
Borsa Para Piyasası		0.10%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.00%
Yabancı Hisse Senetleri		0.00%
VIOP Nakit Teminat		0.48%

Varant		0.00%
Forward		0.00%
Vadeli_TL		0.00%
Vadeli_YP		1.73%
Opsiyon APG		0.00%
Opsiyon		0.00%
Katılma Belgesi		0.00%
Katılma Belgesi YP		0.00%
CC Swap		0.00%
FX Swap		0.00%
IR Swap		0.00%
VDMK		2.78%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	:	17.03%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri		34.59%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	:	141.052
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	:	27,817,216.18
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	:	23,735,724.60

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.(DÖVIZ EN.)	:			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER	:			
F) FİNANSMAN BONOLARI	:			
TRFAKFK41916		4,000,000.00	3,995,480.00	1.11
TRFALNF61916		2,500,000.00	2,408,000.00	0.67
TRFBOLU71910		1,650,000.00	1,549,036.50	0.43
TRFDGOZ71915		1,976,400.00	1,976,400.00	0.55
TRFFFKR41936		2,800,000.00	2,786,112.00	0.78
TRFFNBK41926		5,000,000.00	4,966,900.00	1.39
TRFFNBK51925		5,000,000.00	4,889,650.00	1.36
TRFFNYM41932		5,000,000.00	4,956,700.00	1.38
TRFGRFA41919		6,800,000.00	6,687,596.00	1.87
TRFGRFA41927		2,000,000.00	1,979,760.00	0.55
TRFGRFA41935		4,000,000.00	3,993,080.00	1.11
TRFGRFA51918		10,000.00	9,822.40	0.00
TRFGRFK51925		24,000,000.00	23,424,000.00	6.54
TRFHLFK51918		4,000,000.00	3,909,240.00	1.09
TRFHLFK71916		10,000,000.00	9,488,900.00	2.65
TRFISFA41921		1,250,000.00	1,235,287.50	0.34
TRFISFA51912		5,000,000.00	4,860,150.00	1.36

TRFISFN41916		5,010,000.00	4,996,873.80	1.39
TRFISFN41957		4,000,000.00	3,964,040.00	1.11
TRFISFN51923		4,000,000.00	3,870,600.00	1.08
TRFISMD41939		5,000,000.00	4,991,300.00	1.39
TRFISMD519G1		8,340,000.00	8,121,658.80	2.27
TRFOTKO41910		2,520,000.00	2,489,104.80	0.69
TRFOYMD61917		2,500,000.00	2,392,050.00	0.67
TRFSUZK51914		1,500,000.00	1,449,120.00	0.40
TRFTBTF51915		2,000,000.00	1,932,740.00	0.54
TRFVFAS51915		10,080,000.00	9,856,123.20	2.75
TRFVFAS61914		5,000,000.00	4,753,900.00	1.33
TOPLAM		134,936,400.00	131,933,625.00	36.81
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
TRFGRFA41927		4,000,000.00	3,959,520.00	1.10
TOPLAM		4,000,000.00	3,959,520.00	1.10
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:			
TRSAKFKK1910		200,000.00	275,970.00	0.08
TRSAKYP41612		3,253,744.00	3,421,018.98	0.95
TRSARCL22117		5,000,000.00	5,151,150.00	1.44
TRSAYGZ12024		5,000,000.00	4,614,800.00	1.29
TRSCMSA32112		3,190,000.00	3,213,701.70	0.90
TRSENSA72211		5,000,000.00	6,310,150.00	1.76
TRSISGY32111		3,640,000.00	3,594,463.60	1.00
TRSISGY61912		3,000,000.00	3,002,850.00	0.84
TRSISGYE1915		2,760,000.00	2,841,889.20	0.79
TRSKALE62114		5,000,000.00	5,030,350.00	1.40
TRSKCTF32014		2,000,000.00	1,896,500.00	0.53
TRSKCTY32015		3,410,000.00	3,456,035.00	0.96
TRSKCTY62012		4,000,000.00	4,158,040.00	1.16
TRSKFTF42016		4,800,000.00	4,841,616.00	1.35
TRSKFTF61917		3,000,000.00	3,085,110.00	0.86
TRSKFTF61925		2,600,000.00	2,707,796.00	0.76
TRSKRSNE1911		5,700,000.00	5,873,166.00	1.64
TRSKRSNE2018		200,000.00	205,302.00	0.06
TRSOPAS22111		11,000,000.00	11,066,110.00	3.09
TRSOPAS42010		7,000,000.00	7,477,470.00	2.09
TRSORFN72013		3,490,000.00	3,586,777.70	1.00
TRSOTKO12013		5,000,000.00	5,170,850.00	1.44
TRSOTKO32110		5,000,000.00	5,046,450.00	1.41
TRSRNSH22023		5,000,000.00	5,126,750.00	1.43
TRSRNSHE1916		500,000.00	524,685.00	0.15
TRSSRTNE1912		3,000,000.00	3,136,650.00	0.88
TRSTHALE2716		3,200,000.00	3,228,864.00	0.90
TRSTIMG41917		2,200,000.00	2,303,708.00	0.64
TRSTIMGE1918		2,000,000.00	2,046,520.00	0.57
TRSTISB72712		11,000,000.00	11,312,070.00	3.16
TRSTPRS12115		1,000,000.00	1,045,930.00	0.29
TRSTTRK42012		2,740,000.00	3,025,398.40	0.84
TRSVKFB92719		3,000,000.00	3,019,710.00	0.84

TRSYDAT22015		10,000,000.00	9,886,200.00	2.76
TOPLAM		136,883,744.00	140,684,051.58	39.25
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
H) KİRA SERTİFİKALARI	:			
TRD220921T16		3,000,000.00	4,215,420.00	1.18
TOPLAM		3,000,000.00	4,215,420.00	1.18
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
TRT020823T11		4,918,020.00	8,517,808.08	2.38
TRT110320T18		5,229,380.00	5,010,475.34	1.40
TRT120619T17		14,074,980.00	13,027,235.90	3.63
TRT280628T18		25,632,680.00	27,056,566.84	7.55
TOPLAM		49,855,060.00	53,612,086.16	14.96
L) DİĞER	:			
Forward EURO/TL		-1,000,000.00		
Vadeli Mevduat YP gün 38		1,000,000.00	6,320,616.53	1.76
BPP		296,616.73	296,616.73	0.08
TOPLAM			6,617,233.26	1.85
M) VARANT	:			
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:			
		1,755,891.67	1,755,891.67	0.49
TOPLAM		1,755,891.67	1,755,891.67	0.49
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
O) VDMK	:			
TRPKYVFA2318		7,000,000.00	7,275,310.00	2.03
TRPTYV232410		5,000,000.00	5,038,300.00	1.41
TOPLAM		12,000,000.00	12,313,610.00	3.44
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU :

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	358,400,272.67
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	17,313.44
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	7,942,780.10
FON TOPLAM DEĞERI	:	345,077,387.04

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER :

Açıklama		Tutarı
37001	Fon Yönetim Ücreti	541,917.45
37002	Denetim Ücreti	42.90
370031	SGMK Tahvil Borsa Payı	372.29
370032	O/N RRP Tahvil Borsa Payı	13,234.20
37005	Vergi, Resim ve Harçlar	110.44

37006	Saklama Giderleri	9,927.11
37008	Banka Masrafları	899.78
37015	Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	244.55
37021	Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	6,026.29
37023	VIOP İşlemi Komisyonu	3,371.97
37028	Portföy Saklama Hizmeti	3,234.00
37030	E-fatura Gideri	118.00
Toplam		579,498.98

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
TRSTBTF31910	01.03.2019	1300000.00
TRFHLFK31910	06.03.2019	10000000.00
TRSKCTF31917	11.03.2019	2000000.00
TRSCLKM31910	15.03.2019	3850000.00
TRSGFYH31914	25.03.2019	5450000.00
TRFAKYM31914	28.03.2019	24000000.00
TRFISFN31933	28.03.2019	13660000.00
TRFAKYM31922	29.03.2019	3500000.00
TRSISGY31915	29.03.2019	2500000.00

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