

YKP**(YBP) YAPI KREDİ PORTFOY PY BİRİNCİ DEĞİŞKEN ÖZEL FON****EKİM 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. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	212,489,972.12
D. KATILMA PAYI SAYISI	:	129,877,750.00
E. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	10.08.1998
F. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER TL

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	1.636077
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	1.590376
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	2.87%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	16.88%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	22.49%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		17.02%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		14.11%
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		17.92%
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		0.77%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getiriler		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		34.56%
Yabancı Hisse Senetleri		0.00%

VIOP Nakit Teminat	0.00%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	7.24%
Vadeli_YP	0.00%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	8.38%
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. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	187.46%
G. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	:
Ğ. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN	:
KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	0.00
H. 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	35,000,000.00	31,571,400.00	13.68
TRT110827T16	69,000.00	60,049.32	0.03
TRT140922T17	14,000.00	12,869.64	0.01
TRT180123T10	20,000,000.00	19,867,400.00	8.61
TRT240724T15	27,000.00	23,704.11	0.01
TRT270923T11	10,000.00	8,787.60	0.00
TOPLAM	55,120,000.00	51,544,210.67	22.33
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
TRT180123T10	18,000,000.00	17,845,740.00	7.73
TOPLAM	18,000,000.00	17,845,740.00	7.73
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ	:		
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)	:		
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER	:		
TRT171221F16	900,000.00	8,671,215.48	3.76
TOPLAM	900,000.00	8,671,215.48	3.76
F) FİNANSMAN BONOLARI	:		
TRFHSBC52115	2,070,000.00	1,925,037.90	0.83
TRFYKBK12122	1,600,000.00	1,560,352.00	0.68
TOPLAM	3,670,000.00	3,485,389.90	1.51
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		

G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:			
TRSAKYP41612		428,128.00	450,138.06	0.20
TRSARCL22117		6,210,000.00	6,365,871.00	2.76
TRSARCL72112		4,940,000.00	4,978,433.20	2.16
TRISISGY32111		910,000.00	927,963.40	0.40
TRSKFTF62113		640,000.00	652,076.80	0.28
TRSOPAS22129		1,100,000.00	1,129,150.00	0.49
TRSTISB72712		1,580,000.00	1,643,942.60	0.71
TRSTISB92918		3,000,000.00	3,043,770.00	1.32
TRSVKFB92719		2,080,000.00	2,260,315.20	0.98
TRSYKKB62914		1,800,000.00	1,857,330.00	0.80
TRSYKKB92911		3,000,000.00	3,093,270.00	1.34
TOPLAM		25,688,128.00	26,402,260.26	11.44
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
H) KİRA SERTİFİKALARI	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
US900123AL40		1100000.00	12136390.08	5.26
US900123AW05		250000.00	2165418.09	0.94
US900123BH29		362000.00	3036185.41	1.32
US900123BJ84		300000.00	2077440.49	0.90
US900123BY51		1000000.00	8316549.74	3.60
US900123CJ75		1400000.00	10394704.73	4.50
US900123CL22		1000000.00	7923571.88	3.43
US900123CM05		1450000.00	9731899.38	4.22
US900123CR91		1500000.00	13089216.00	5.67
TOPLAM		8,362,000.00	68,871,375.81	29.84
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
TRT140623T19		9,804,365.00	10,512,729.45	4.55
TRT210623T10		9,217,005.00	9,010,910.96	3.90
TOPLAM		19,021,370.00	19,523,640.41	8.46
L) DİĞER	:			
YAY		22,038.00	2,836,915.51	1.23
YBE		9,205,454.00	2,023,727.01	0.88
YBS		463,301,019.00	11,866,065.70	5.14
YHS		391,125.00	612,431.35	0.27
YPL		191,985.00	1,703,269.34	0.74
Vadeli Mevduat gün 36		3,756,215.66	3,793,233.21	1.64
Vadeli Mevduat gün 36		3,757,699.92	3,794,875.44	1.64
Vadeli Mevduat gün 36		3,764,673.22	3,802,061.29	1.65
Vadeli Mevduat gün 36		3,755,343.10	3,791,922.32	1.64
BPP		228,265.17	228,265.17	0.10
TOPLAM			34,452,766.33	14.93
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	:	230,796,598.87
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	6,333.90
C. ALACAKLAR (+)	:	24,404.80
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	17,887,227.39
FON TOPLAM DEĞERİ	:	212,489,972.12

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER :

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	18,380.73
37002 Denetim Ücreti	929.92
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	2,888.81
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	10,021.20
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	58.80
37006 Saklama Giderleri	5,075.66
37008 Banka Masrafları	24.16
37010 Kap Gideri	509.12
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	1,125.75
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	3,726.34
37028 Portföy Saklama Hizmeti	3,584.00
37030 E-fatura Gideri	118.00
37099 Diğer Giderler	313.92
Toplam	46,756.41

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

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