

YKP
(YOT) YAPI KREDİ PORTFOY ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
EKİM 2020 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	(YOT) YAPI KREDİ PORTFOY ORTA VADELİ BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
Ç. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	159,068,863.74
D. KATILMA PAYI SAYISI	:	20,198,308.01
E. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	29.08.1996
F. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER TL

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	7.875356
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	7.907681
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	-0.41%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	6.40%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	9.23%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		62.21%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		22.08%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		0.26%
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		7.98%
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		0.20%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getiriler		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.00%
Yabancı Hisse Senetleri		0.00%

VIOP Nakit Teminat	2.21%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	1.23%
Vadeli_YP	0.00%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	3.49%
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	0.35%
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	39.85%
G. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	:
Ğ. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN	:
KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	5,918,767.29
H. KATILMA PAYI İADELERİNDEN	:
KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	12,816,742.78

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ	:		
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI	:		
TRB091220T11	2,000,000.00	1,973,020.00	1.24
TRT020322T17	200,000.00	195,928.00	0.12
TRT080323T10	40,000.00	34,671.20	0.02
TRT080328T15	100,000.00	93,854.00	0.06
TRT090621T18	6,000,000.00	5,526,480.00	3.46
TRT110226T13	10,000,000.00	9,020,400.00	5.65
TRT120122T17	61,000.00	59,733.03	0.04
TRT120325T12	13,000.00	10,537.67	0.01
TRT140421T13	13,000,000.00	12,231,830.00	7.67
TRT140623T19	3,300,000.00	3,620,661.00	2.27
TRT140922T17	1,592,000.00	1,463,461.92	0.92
TRT170221T12	18,400,000.00	18,636,256.00	11.68
TRT180123T10	11,500,000.00	11,423,755.00	7.16
TRT200324T13	15,000.00	13,651.50	0.01
TRT201021T25	4,000,000.00	4,000,720.00	2.51
TRT210421T14	4,000,000.00	4,144,600.00	2.60
TRT220921T18	14,500,000.00	14,041,075.00	8.80
TRT240227T17	200,000.00	178,234.00	0.11
TRT240724T15	222,000.00	194,900.46	0.12
TRT270923T11	9,141,000.00	8,032,745.16	5.04

TOPLAM	98,284,000.00	94,896,513.94	59.49
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ	:		
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)	:		
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER	:		
F) FİNANSMAN BONOLARI	:		
TRFAKBK12122	4,900,000.00	4,800,922.00	3.01
TRFGRFA12118	3,000,000.00	2,944,890.00	1.85
TRFHSBC52115	1,680,000.00	1,562,349.60	0.98
TRFISFN12123	2,000,000.00	1,939,500.00	1.22
TRFYKBKA2010	4,000,000.00	4,039,960.00	2.53
TOPLAM	15,580,000.00	15,287,621.60	9.58
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSAKFH22212	1,500,000.00	1,530,390.00	0.96
TR SARCL22117	1,000,000.00	1,025,100.00	0.64
TR SARCL72112	1,800,000.00	1,814,004.00	1.14
TRSCMSA32112	500,000.00	508,500.00	0.32
TR SENSEA72211	2,450,000.00	3,871,833.00	2.43
TR SOPAS22111	1,500,000.00	1,550,205.00	0.97
TR SOTKO32110	1,500,000.00	1,526,985.00	0.96
TR STHALE2716	800,000.00	803,216.00	0.50
TR STISB72712	100,000.00	104,047.00	0.07
TR STISB92918	800,000.00	811,672.00	0.51
TR SVKFB92719	2,000,000.00	2,173,380.00	1.36
TR SYKBK62914	2,700,000.00	2,785,995.00	1.75
TR SYKBK92911	1,000,000.00	1,031,090.00	0.65
TOPLAM	17,650,000.00	19,536,417.00	12.25
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
TRD260122T19	430,000.00	423,120.00	0.27
TOPLAM	430,000.00	423,120.00	0.27
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TRT120128T11	12,509,570.00	19,023,034.25	11.93
TOPLAM	12,509,570.00	19,023,034.25	11.93
L) DİĞER	:		
YPK	2,922,534.00	5,776,113.73	3.62
F_USDTRY1220	-2,000.00	-17,105,000.00	
BPP	321,372.00	321,372.00	0.20
TOPLAM		6,097,485.73	3.82
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		
	3,679,107.82	3,679,107.82	2.31
TOPLAM	3,679,107.82	3,679,107.82	2.31
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:		

VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
O) VDMK	:			
TRPTYV232410		500,000.00	574,535.00	0.36
TOPLAM		500,000.00	574,535.00	0.36
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	159,517,835.34
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	7,072.30
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	456,043.90
FON TOPLAM DEĞERİ	:	159,068,863.74

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	431,851.64
37002 Denetim Ücreti	942.72
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	694.34
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	3,528.00
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	58.80
37006 Saklama Giderleri	4,797.84
37008 Banka Masrafları	572.01
37010 Kap Gideri	536.32
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	231.02
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	2,918.42
37023 VIOP İşlemi Komisyonu	7,698.01
37028 Portföy Saklama Hizmeti	3,584.00
37030 E-fatura Gideri	118.00
37099 Diğer Giderler	308.16
Toplam	457,839.28

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

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

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR

8- İTFALAR

Menkul Kıymet Türü	İtfat Tarihi	Nominal
TRT071020T23	07.10.2020	4500000.00
TRSKRSNE2018	13.10.2020	1000000.00
TRFVKFBE2057	16.10.2020	3000000.00
TRFGRANE2027	27.10.2020	4000000.00

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