YKP

(YDP) YAPI KREDI PORTFOY PY ÜCÜNCÜ DEGISKEN OZEL FON

OCAK 2020 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	**(YDP) YAPI KREDI PORTFOY PY ÜCÜNCÜ DEGISKEN OZEL FON**
B. KURUCUNUN UNVANI	:	**YKP**
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	**YAPI KREDI PORTFOY YONETIMI AS**
Ç. FON TUTARI	:	300,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	788,205,141.04
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	29,916,689,808.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	20.07.2012
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.026347
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.025593
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	2.95%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	2.95%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	27.51%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		7.76%
Devlet Tahvili		44.64%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		17.06%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		0.58%
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		19.98%
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		0.04%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.81%

Yabancı Hisse Senetleri		0.00%
VIOP Nakit Teminat		0.84%
Varant		0.00%
Forward		0.00%
Vadeli_TL		0.00%
Vadeli_YP		2.98%
Opsiyon APG		0.00%
Opsiyon		0.00%
Katılma Belgesi		5.08%
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		0.22%
F. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	:	57.40%
G. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:	
Hisse Senedi		30.56%
Devlet Borçlanma Senetleri		64.51%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	:	499.364
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	:	87,257,031.45
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	:	15,002,269.02

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU :

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ :			
AKBNK	400,000.00	3,304,000.00	0.42
ARCLK	67,500.00	1,410,750.00	0.18
ASELS	125,000.00	2,932,500.00	0.37
BIMAS	66,000.00	3,219,480.00	0.41
ENKAI	0.54	3.83	0.00
EREGL	400,009.00	3,732,083.97	0.47
GARAN	275,000.00	3,272,500.00	0.42
GUSGR	1,000,000.00	2,560,000.00	0.32
HALKB	100,000.00	692,000.00	0.09
ISCTR	200,000.00	1,450,000.00	0.18
ISDMR	60,000.00	466,200.00	0.06
ISGYO	1.08	2.02	0.00
ISMEN	120,000.00	592,800.00	0.08
KAREL	60,000.00	1,038,000.00	0.13
KCHOL	145,000.00	2,833,300.00	0.36
KORDS	74,000.00	1,040,440.00	0.13
ODAS	1.18	2.51	0.00
OTKAR	10,600.00	1,720,380.00	0.22
PETKM	350,000.00	1,410,500.00	0.18

PGSUS		30,500.00	2,092,300.00	0.27
SISE		500,000.53	2,780,002.96	0.35
SODA		175,000.02	1,163,750.11	0.15
TCELL		210,000.00	2,961,000.00	0.38
THYAO		250,000.00	3,420,000.00	0.43
TKFEN		157,000.00	3,022,250.00	0.38
TOASO		46,500.00	1,227,600.00	0.16
TSKB		900,000.00	1,233,000.00	0.16
TTKOM		150,000.00	1,162,500.00	0.15
TUPRS		25,500.00	2,871,300.00	0.36
VAKBN		300,001.00	1,980,006.60	0.25
YATAS		170,362.00	1,431,040.80	0.18
YKBNK		850,000.32	2,524,500.95	0.32
TOPLAM		7,217,975.67	59,544,193.75	7.55
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI	:			
TRT030523T13		11,000,000.00	21,290,610.00	2.70
TRT050220T17		300,000.00	310,911.00	0.04
TRT080328T15		100,000.00	118,712.00	0.02
TRT110827T16		269,000.00	292,408.38	0.04
TRT120325T12		20,000.00	19,188.60	0.00
TRT120820T12		200,000.00	235,144.00	0.03
TRT140421T13		15,000,000.00	13,367,400.00	1.70
TRT140623T19		300,000.00	358,626.00	0.05
TRT140922T17		13,500,000.00	13,603,680.00	1.73
TRT160425T17		1,000,000.00	1,702,670.00	0.22
TRT160920T25		10,000,000.00	9,415,800.00	1.19
TRT170221T12		300,000.00	317,322.00	0.04
TRT170822T15		6,100,000.00	6,531,087.00	0.83
TRT180123T10		66,700,000.00	71,086,192.00	9.02
TRT200324T13		67,000.00	71,178.79	0.01
TRT201021T25		66,000,000.00	72,631,680.00	9.21
TRT210421T14		12,000,000.00	14,181,120.00	1.80
TRT220921T18		35,200,000.00	36,014,176.00	4.57
TRT240724T15		53,022,000.00	51,645,548.88	6.55
TRT261022T10		1,000,000.00	2,127,950.00	0.27
TOPLAM		292,078,000.00	315,321,404.65	40.00
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ	:			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVIZ EN.)	:			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER	:			
TRT171221F16		410,000.00	2,712,008.82	0.34
TOPLAM		410,000.00	2,712,008.82	0.34
F) FİNANSMAN BONOLARI	:			
TRFTCZB82013		3,550,000.00	3,642,974.50	0.46
TRFTISB52018		200,000.00	194,458.00	0.02
TRFYKBK62028		20,000,000.00	20,209,400.00	2.56
TOPLAM		23,750,000.00	24,046,832.50	3.05
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:			

TRSARCL22117		10,690,000.00	11,120,272.50	1.41
TRSARCL72112		7,320,000.00	7,308,507.60	0.93
TRSAYGZ62110		2,800,000.00	2,820,552.00	0.36
TRSENSA72211		5,100,000.00	7,190,949.00	0.91
TRSERGL52117		2,900,000.00	2,997,295.00	0.38
TRSKCTF32014		2,000,000.00	2,108,360.00	0.27
TRSKCTY32015		110,000.00	112,327.60	0.01
TRSKCTY62012		1,000,000.00	1,019,020.00	0.13
TRSKFTF42016		3,050,000.00	3,204,848.50	0.41
TRSKFTF62113		180,000.00	184,392.00	0.02
TRSKRSNE2018		2,000,000.00	2,013,320.00	0.26
TRSOPAS22111		1,000,000.00	1,023,190.00	0.13
TRSOPAS22129		4,390,000.00	4,601,729.70	0.58
TRSOPAS42010		6,820,000.00	7,175,526.60	0.91
TRSOTKO32110		8,000,000.00	8,151,200.00	1.03
TRSTHALE2716		500,000.00	500,325.00	0.06
TRSTISB72712		5,140,000.00	5,327,507.20	0.68
TRSTISB92918		8,000,000.00	8,091,600.00	1.03
TRSTPRS12115		4,000,000.00	4,011,960.00	0.51
TRSTTRK42012		140,000.00	141,733.20	0.02
TRSVKFB92719		2,170,000.00	2,345,466.20	0.30
TRSYKBK62914		6,300,000.00	6,301,827.00	0.80
TRSYKBK92911		10,000,000.00	10,043,700.00	1.27
XS1629734879		2,350,000.00	2,417,703.50	0.31
TOPLAM		95,960,000.00	100,213,312.60	12.71
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
H) KİRA SERTİFİKALARI	:			
TRD260122T19		24,750,000.00	24,949,485.00	3.16
TOPLAM		24,750,000.00	24,949,485.00	3.16
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:			
XS1079527211		1000000.00	6136577.73	0.78
TOPLAM		1,000,000.00	6,136,577.73	0.78
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:			
J) REPO	:			
K) TERS REPO	:			
TRT060825T15		18,397,530.00	20,017,063.01	2.54
TRT070727T13		9,474,675.00	13,011,090.96	1.65
TRT080328T15		10,473,260.00	12,010,208.22	1.52
TRT110226T13		13,400,065.00	14,011,909.59	1.78
TRT110827T16		11,969,840.00	12,510,633.56	1.59
TRT170221T12		17,110,565.00	17,514,886.99	2.22
TRT200422T14		14,708,490.00	15,513,185.62	1.97
TRT201021T25		6,579,615.00	7,005,972.05	0.89
TRT230222T13		2,803,350.00	6,005,104.11	0.76
TRT270923T11		11,919,425.00	11,509,735.62	1.46
TRT270923T11		41,459,070.00	40,034,093.15	5.08
TRT280628T18		2,037,730.00	2,502,126.71	0.32
TOPLAM		160,333,615.00	171,646,009.59	21.77

L) DİĞER	:			
GLDTRF		1,750,000.00	47,549,250.00	6.03
YPF		1,094,719.00	1,745,941.06	0.22
YSF		1,235,967.00	1,106,983.96	0.14
YPL		400,000.00	2,647,304.78	0.34
Vadeli Mevduat YP gün 44		1,532,700.21	10,097,389.99	1.28
Vadeli Mevduat YP gün 45		2,042,852.89	12,234,920.97	1.55
F_XAUTRYM0220		19,848.00	6,088,572.48	
BPP		227,194.04	227,194.04	0.03
TOPLAM			75,608,984.79	9.59
M) VARANT	:			
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:			
		6,437,238.80	6,437,238.80	0.82
TOPLAM		6,437,238.80	6,437,238.80	0.82
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:			
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			
O) VDMK	:			
TRPTYV232410		1,500,000.00	1,757,025.00	0.22
TOPLAM		1,500,000.00	1,757,025.00	0.22
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU :

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	788,373,073.24
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	2,736.04
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	170,668.24
FON TOPLAM DEĞERI	:	788,205,141.04

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER :

Açıklama		Tutarı
37001	Fon Yönetim Ücreti	135,554.74
37002	Denetim Ücreti	858.00
370031	SGMK Tahvil Borsa Payı	3,092.69
370032	O/N RRP Tahvil Borsa Payı	40,576.20
370033	Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	75.60
370034	Yabancı Menkul Komisyonu	412.41
37004	Aracılık Komisyonu	11,874.87
37005	Vergi, Resim ve Harçlar	58.80
37006	Saklama Giderleri	8,052.88
37008	Banka Masrafları	629.79
37009	Noter Tasdik ve Ücreti	106.54
37010	Kap Gideri	281.49
37015	Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	223.94
37021	Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	13,699.19
37023	VIOP İşlemi Komisyonu	9,719.23
37028	Portföy Saklama Hizmeti	5,152.00
37030	E-fatura Gideri	118.00

37099	Diğer Giderler	156.42
Toplam		230,642.79

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

Açıklama	Giriş Tarihi	Stok	Kazanılan Nominal
ODAS Bdl :%103.57	21.01.2020	0.58	0.60

7- PORTFÖYDEN SATIŞLAR :

8- İTFALAR :

Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal
TRT150120T16	15.01.2020	200000.00
TRSAYGZ12024	24.01.2020	1000000.00
TRSOTKO12013	31.01.2020	6500000.00

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