

YKP
(YBS) YAPI KREDİ PORTFOY ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
ŞUBAT 2020 AYLIK RAPORUDUR.

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI	:	(YBS) YAPI KREDİ PORTFOY ÖZEL SEKTÖR BORÇLANMA ARAÇLARI FONU
B. KURUCUNUN UNVANI	:	YKP
C. YÖNETİCİNİN UNVANI	:	YAPI KREDİ PORTFOY YÖNETİMİ A.Ş.
Ç. FON TUTARI	:	600,000,000.00
D. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ	:	814,309,068.40
E. KATILMA PAYI SAYISI	:	33,742,143,817.00
F. FONUN KURULUŞ TARİHİ	:	25.01.2012
G. FONUN SÜRESİ	:	Süresiz

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	:	0.024133
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI	:	0.023965
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	0.70%
Ç. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI	:	1.71%
D. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI	:	18.46%
E. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	:	
Hisse Senedi		0.00%
Devlet Tahvili		0.31%
Hazine Bonosu		0.00%
Özel Sektör Tahvili		84.80%
Yapılandırılmış Ürünler		0.00%
Yapılandırılmış ÜrünlerYP		0.00%
Kira Sertifikası-Kamu-TL		3.11%
Kira Sertifikası-Kamu-YP		0.00%
Kira Sertifikası-Özel Sektör-TL		0.28%
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		8.74%
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		0.07%
Kıymetli Madenler		0.00%
Yabancı Sabit Getirililer		0.00%
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)		0.00%

Yabancı Hisse Senetleri	0.00%
VIOP Nakit Teminat	0.24%
Varant	0.00%
Forward	0.00%
Vadeli_TL	1.77%
Vadeli_YP	0.00%
Opsiyon APG	0.00%
Opsiyon	0.00%
Katılma Belgesi	0.00%
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	0.69%
F. AYLİK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI	: 35.21%
G. AYLİK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	:
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	41.49%
Ğ. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ	: 80.445
H. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 87,966,031.97
I. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	: 102,171,781.41

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI			
TRT260122T11	500,000.00	504,530.00	0.06
TOPLAM	500,000.00	504,530.00	0.06
VALÖRLÜ İŞLEMLER			
C) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ			
D) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ.(DÖVİZ EN.)			
E) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER			
F) FİNANSMAN BONOLARI			
TRFAKBK32021	25,000,000.00	24,993,000.00	3.05
TRFAKBK52011	10,000,000.00	9,810,300.00	1.20
TRFAKBK52037	25,000,000.00	25,075,750.00	3.06
TRFAKYM32011	10,000,000.00	9,925,200.00	1.21
TRFDFKT82014	3,000,000.00	2,848,440.00	0.35
TRFDGOZ71915	1,325,430.00	1,325,430.00	0.16
TRFDNFK42011	30,000,000.00	29,659,800.00	3.62
TRFDZBK32023	10,000,000.00	10,263,200.00	1.25
TRFDZBK42022	30,000,000.00	29,584,200.00	3.61
TRFDZBK82036	20,000,000.00	19,099,000.00	2.33
TRFEGYO62014	10,000,000.00	9,738,400.00	1.19

TRFFNBK32032	10,000,000.00	9,949,500.00	1.21
TRFFNBK42015	7,500,000.00	7,411,875.00	0.90
TRFFNBK42031	30,000,000.00	29,639,400.00	3.61
TRFFNBK52014	5,000,000.00	4,913,800.00	0.60
TRFFNYM32014	5,000,000.00	4,975,500.00	0.61
TRFFNYM42013	10,000,000.00	9,895,500.00	1.21
TRFGRAN32011	33,400,000.00	33,571,676.00	4.09
TRFGRAN32037	5,000,000.00	4,970,900.00	0.61
TRFGRAN42010	2,900,000.00	2,909,425.00	0.35
TRFHLFK52015	15,000,000.00	14,711,400.00	1.79
TRFISFN52012	14,630,000.00	14,311,212.30	1.74
TRFISFN52020	20,000,000.00	19,513,400.00	2.38
TRFISGY52017	11,500,000.00	11,196,400.00	1.36
TRFISMD32052	5,000,000.00	4,984,450.00	0.61
TRFISMD42051	10,000,000.00	9,899,200.00	1.21
TRFISMD42077	5,000,000.00	4,949,600.00	0.60
TRFISMD52050	5,000,000.00	4,916,700.00	0.60
TRFOYMD32017	8,000,000.00	7,944,960.00	0.97
TRFOYMD42016	5,000,000.00	4,942,400.00	0.60
TRFTCZB32018	19,780,000.00	20,335,818.00	2.48
TRFTCZB32026	3,170,000.00	3,248,108.80	0.40
TRFTCZB82013	8,870,000.00	8,880,821.40	1.08
TRFTHAL82030	7,000,000.00	7,010,290.00	0.85
TRFTISB52018	37,930,000.00	37,176,330.90	4.53
TRFVFAS32014	15,000,000.00	14,927,550.00	1.82
TRFVFAS42013	10,000,000.00	9,909,600.00	1.21
TRFVKFB42059	10,000,000.00	9,912,400.00	1.21
TRFVKFB52033	10,000,000.00	9,825,900.00	1.20
TRFVKFB82022	15,000,000.00	15,045,300.00	1.83
TRFYAKF32015	10,000,000.00	9,997,000.00	1.22
TRFYKBK32013	10,000,000.00	10,096,700.00	1.23
TRFYKYM42036	7,000,000.00	6,919,080.00	0.84
TRFYKYM42044	5,000,000.00	4,930,200.00	0.60
TRFYKYM52019	4,000,000.00	3,932,280.00	0.48
TOPLAM	555,005,430.00	550,077,397.40	67.05
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
G) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ	:		
TRSAKFH22212	7,000,000.00	7,059,640.00	0.86
TRSAKYP41612	3,253,744.00	3,421,018.98	0.42
TR SARCL22117	5,000,000.00	5,075,150.00	0.62
TR SAYGZ62110	2,100,000.00	2,135,196.00	0.26
TRSBOLU72119	2,500,000.00	2,482,425.00	0.30
TRSCMSA32112	3,190,000.00	3,275,268.70	0.40
TR SENSEA72211	5,000,000.00	7,127,050.00	0.87
TRSERGL52117	3,500,000.00	3,520,650.00	0.43
TRSGRAN23013	11,250,000.00	11,318,962.50	1.38
TRSIGY32111	3,640,000.00	3,732,892.80	0.46
TRSKALE62114	5,000,000.00	5,042,800.00	0.61
TRSKCTF32014	2,120,000.00	2,262,146.00	0.28

TRSKCTY32015	3,410,000.00	3,520,790.90	0.43
TRSKCTY62012	4,000,000.00	4,116,800.00	0.50
TRSKFTF42016	4,700,000.00	4,980,496.00	0.61
TRSKFTF62113	4,000,000.00	4,139,160.00	0.50
TRSKRSNE2018	200,000.00	204,226.00	0.02
TRSOPAS22111	10,900,000.00	10,873,077.00	1.33
TRSOPAS42010	7,000,000.00	7,429,380.00	0.91
TRSORFN72013	3,490,000.00	3,572,538.50	0.44
TRSOTKO32110	5,000,000.00	5,261,650.00	0.64
TRSSRTN72114	2,500,000.00	2,488,150.00	0.30
TRSTBTF32116	10,000,000.00	10,132,100.00	1.24
TRSTHALE2716	3,200,000.00	3,198,048.00	0.39
TRSTISB22212	10,000,000.00	10,062,500.00	1.23
TRSTISB72712	11,000,000.00	11,107,910.00	1.35
TRSTISB92918	8,000,000.00	8,186,000.00	1.00
TRSTPRS12115	1,000,000.00	1,011,430.00	0.12
TRSTTRK42012	2,740,000.00	2,799,375.80	0.34
TRSVKFB92719	3,000,000.00	3,275,820.00	0.40
TRSYKBK32115	10,000,000.00	10,053,600.00	1.23
TRSYKBK62914	4,500,000.00	4,576,995.00	0.56
TRSYKBK92911	10,000,000.00	10,182,600.00	1.24
TOPLAM	172,193,744.00	177,625,847.18	21.65
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
H) KİRA SERTİFİKALARI	:		
TRD151221T10	18,160,000.00	18,861,520.80	2.30
TRD181120T19	8,950,000.00	9,863,616.00	1.20
TRD220921T16	3,000,000.00	4,787,580.00	0.58
TRD260122T19	14,370,000.00	14,353,761.90	1.75
TRDVVRK42024	670,000.00	679,031.60	0.08
TOPLAM	45,150,000.00	48,545,510.30	5.92
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		
I) YABANCI MENKUL KIYMETLER	:		
İ) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER	:		
J) REPO	:		
K) TERS REPO	:		
TRT050624T19	9,980,785.00	10,009,024.66	1.22
TRT170221T12	245,999.00	245,192.11	0.03
TRT280628T18	7,652,060.00	10,009,041.10	1.22
TOPLAM	17,878,844.00	20,263,257.87	2.47
L) DİĞER	:		
Vadeli Mevduat gün 94	15,000,000.00	15,122,847.69	1.84
BPP	291,263.10	291,263.10	0.04
TOPLAM		15,414,110.79	1.88
M) VARANT	:		
N) VIOP NAKİT TEMİNAT	:		
	2,032,995.65	2,032,995.65	0.25
TOPLAM	2,032,995.65	2,032,995.65	0.25
O) YAPILANDIRILMIŞ ÜRÜNLER	:		
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:		

O) VDMK	:			
TRPTYV232410		5,000,000.00	5,910,550.00	0.72
TOPLAM		5,000,000.00	5,910,550.00	0.72
VALÖRLÜ İŞLEMLER	:			

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU	:	820,374,199.19
B. HAZIR DEĞERLER (+)	:	7,411.57
C. ALACAKLAR (+)	:	0.00
D. DİĞER VARLIKLAR (+)	:	0.00
E. BORÇLAR (-)	:	1,326,093.39
FON TOPLAM DEĞERİ	:	814,309,068.40

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001 Fon Yönetim Ücreti	1,183,654.21
37002 Denetim Ücreti	200.20
370031 SGMK Tahvil Borsa Payı	2,714.04
370032 O/N RRP Tahvil Borsa Payı	17,215.36
37005 Vergi, Resim ve Harçlar	150.50
37006 Saklama Giderleri	19,245.40
37008 Banka Masrafları	950.06
370142 KYD Endeks Lisans Giderleri	1,752.30
37015 Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	379.19
37021 Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	13,152.02
37028 Portföy Saklama Hizmeti	4,186.00
37030 E-fatura Gideri	118.00
Toplam	1,243,717.28

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	İtfa Tarihi	Nominal
TRFOYMD22018	03.02.2020	1000000.00
TRFALNF22017	04.02.2020	5000000.00
TRFDFKT22010	12.02.2020	3000000.00
TRD120220T16	12.02.2020	2270000.00
TRFFNBK22025	14.02.2020	15000000.00
TRSYDAT22015	14.02.2020	10000000.00
TRFAKBK22055	19.02.2020	10000000.00
TRFYKYM22012	19.02.2020	5000000.00
TRFYKYM22020	19.02.2020	3000000.00

TRSRNSH22023	19.02.2020	5000000.00
TRFAKBK22022	21.02.2020	15000000.00
TRFVKFB22010	21.02.2020	45000000.00
TRDZKVK22014	21.02.2020	8760000.00
TRDZKVK22014	21.02.2020	1120000.00
TRFTHAL22010	26.02.2020	7000000.00

9- PORTFÖYE ALIŞLAR :

10- ÖDÜNÇ İŞLEMLER :

A) ÖDÜNÇ VERİLEN :

Sermaye Piyasası Aracı :

B) ÖDÜNÇ ALINAN :

Sermaye Piyasası Aracı :

Menkul Kıymet

Nominal

Vade Tarihi

Cari Piyasa Değeri

Menkul Kıymet

Nominal

Vade Tarihi

Cari Piyasa Değeri