

**YAPI KREDİ PORTFÖY EUROBOND
(DOLAR) BORÇLANMA ARAÇLARI FONU**

**1 OCAK - 31 ARALIK 2022 DÖNEMİNE AİT
PERFORMANS SUNUŞ RAPORU VE
YATIRIM PERFORMANSI KONUSUNDA KAMUYA
AÇIKLANAN BİLGİLERE İLİŞKİN RAPOR**



**YAPI KREDİ PORTFÖY EUROBOND
(DOLAR) BORÇLANMA ARAÇLARI FONU**

**YATIRIM PERFORMANSI KONUSUNDA
KAMUYA AÇIKLANAN BİLGİLERE İLİŞKİN RAPOR**

Yapı Kredi Portföy Eurobond (Dolar) Borçlanma Araçları Fonu'nun ("Fon") 1 Ocak - 31 Aralık 2022 dönemine ait ekteki performans sunuş raporunu Sermaye Piyasası Kurulu'nun VII - 128.5 sayılı Bireysel Portföylerin ve Kolektif Yatırım Kuruluşlarının Performans Sunumuna, Performansa Dayalı Ücretlendirilmesine ve Kolektif Yatırım Kuruluşlarını Notlandırma ve Sıralama Faaliyetlerine İlişkin Esaslar Hakkında Tebliğ'inde ("Tebliğ") yer alan performans sunuş standartlarına ilişkin düzenlemeleri çerçevesinde incelemiş bulunuyoruz.

İncelememiz sadece yukarıda belirtilen döneme ait performans sunuşunu kapsamaktadır. Bunun dışında kalan dönemler için inceleme yapılmamış ve görüş oluşturulmamıştır.

Görüşümüze göre 1 Ocak - 31 Aralık 2022 dönemine ait performans sunuş raporu Fon'un performansını Tebliğ'de belirtilen performans sunuş standartlarına ilişkin düzenlemelere uygun olarak doğru bir biçimde yansıtmaktadır.

Diğer Husus

Fon'un 31 Aralık 2022 tarihi itibarıyla kamuya açıklanmak üzere ayrıca hazırlanacak yıllık finansal tabloları üzerindeki bağımsız denetim çalışmalarımız henüz tamamlanmamış olup; söz konusu finansal tablolara ilişkin bağımsız denetim çalışmalarımızın tamamlanmasını müteakiben finansal tablolara ilişkin bağımsız denetçi raporumuz ayrıca tanzim edilecektir.

PwC Bağımsız Denetim ve
Serbest Muhasebeci Mali Müşavirlik A.Ş.



Talar Gul, SMMM
Sorumlu Denetçi

İstanbul, 30 Ocak 2023

YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş. TARAFINDAN KURULAN VE YÖNETİLEN YAPI KREDİ PORTFÖY EUROBOND (DOLAR) BORÇLANMA ARAÇLARI FONU

1 OCAK – 31 ARALIK 2022 DÖNEMİNE AİT PERFORMANS SUNUŞ RAPORU

B. PERFORMANS BİLGİSİ

Yıllar	Toplam Getiri (%)	Karşılaştırma Ölçütünün Getirisi / Eşik Değer (%)	Enflasyon Oranı (%) (*)	Portföyün Zaman İçinde Standart Sapması (%)	Karşılaştırma Ölçütünün Standart Sapması/Eşik Değer (%) (**)	Bilgi Rasyosu	Sunuma Dahil Dönem Sonu Portföyün Net Aktif Değeri
2018	26.94	31.17	20.30	1.13	1.19	-0.0460	1,184,194,097.53
2019 (***)	26.18	28.23	11.84	0.66	0.64	-0.0576	1,745,782,387.36
2020	30.05	35.06	14.60	0.79	0.72	-0.0878	2,672,922,311.84
2021	64.16	67.42	36.08	1.92	1.87	-0.0334	4,698,393,670.91
2022 (***)	40.96	42.07	64.27	0.69	0.65	-0.0114	5,173,893,667.37

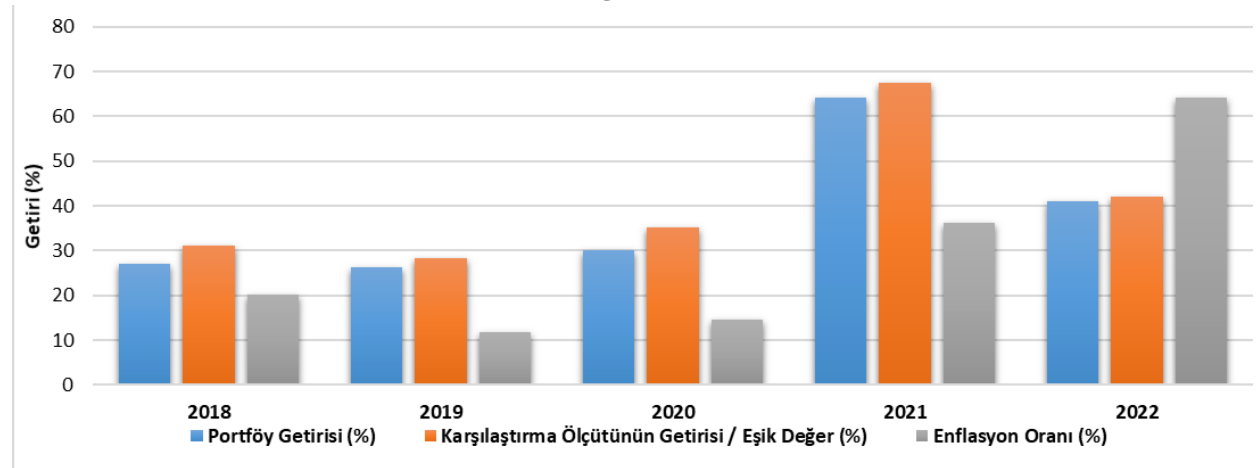
(*) Enflasyon oranı TÜİK tarafından açıklanan TÜFE'nin performans dönemine denk gelen bileşik getirisidir.

(**) Portföyün ve karşılaştırma ölçütünün standart sapması dönemdeki günlük getiriler üzerinden hesaplanmıştır.

(***) 2 Ocak 2019 tarihi itibarıyla fonun karşılaştırma ölçütü %70 BIST-KYD Eurobond USD (TL) + %20 BIST-KYD ÖSBA Eurobond USD (TL) + %10 BIST-KYD Repo (Brüt) Endeksi'dir.

(****) 1 Ocak - 31 Aralık 2022 arasındaki dönemdir.

GRAFİK



"PORTFÖYÜN GEÇMİŞ PERFORMANSI GELECEK DÖNEM PERFORMANSI İÇİN BİR GÖSTERGE OLAMAZ."

**YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş. TARAFINDAN KURULAN VE
YÖNETİLEN YAPI KREDİ PORTFÖY EUROBOND (DOLAR)
BORÇLANMA ARAÇLARI FONU**

1 OCAK - 31 ARALIK 2022 DÖNEMİNE AİT PERFORMANS SUNUŞ RAPORU

C. DİPNOTLAR

1. Yapı Kredi Portföy Yönetimi A.Ş., portföy yönetimi ve yatırım danışmanlığı hizmeti veren bir portföy yönetim şirkettir. Yönetim alanları yatırım fonları, emeklilik fonları ve özel portföy yönetimidir. Kurucu, Fon'un katılma payı sahiplerinin haklarını koruyacak şekilde temsili, yönetimi, yönetiminin denetlenmesi ile faaliyetlerinin içtüzük ve izahname hükümlerine uygun olarak yürütülmesinden sorumludur. Kurucu fona ait varlıklar üzerinde kendi adına ve fon hesabına mevzuat ve içtüzüğe uygun olarak tasarruflarda bulunmaya ve bundan doğan hakları kullanmaya yetkilidir. Fon'un faaliyetlerinin yürütülmesi esnasında portföy yöneticiliği hizmeti de dahil olmak üzere dışarıdan hizmet alınması, Kurucunun sorumluluğunu ortadan kaldırmaz. Fon portföyü, kolektif portföy yöneticiliğine ilişkin Portföy Yönetim Şirketleri Tebliği'nde belirtilen ilkeler ve fon portföyüne dahil edilebilecek varlık ve haklara ilişkin Tebliğ'de yer alan sınırlamalar çerçevesinde yönetilir.

Uzmanlaşılın Yönetim Alanları:

- Yatırım Fonu Portföy Yönetimi
 - Emeklilik Fonu Portföy Yönetimi
 - Özel Portföy Yönetimi
2. Fon portföyünün yatırım amacı ve yatırım stratejisine "A. Tanıtıcı Bilgiler" bölümünde yer verilmiştir.
 3. Fon Portföyü 1 Ocak - 31 Aralık 2022 sunum döneminde "net %40.96 oranında getiri sağlarken, karşılaştırma ölçütü getirisi aynı dönemde %42.07 olmuştur. Sonuç olarak Fon'un nispi getirisi %-1.11 olarak gerçekleşmiştir.

Toplam Getiri : Fonun ilgili dönemdeki birim pay değerindeki yüzdesel getiriyi ifade etmektedir.

Karşılaştırma Ölçütünün Getirisi : Fonun karşılaştırma ölçütünün ilgili dönem içerisinde belirtilen varlık dağılımları ile ağırlıklandırılarak hesaplanmış olan yüzdesel getirisini ifade etmektedir.

Nispi Getiri : Performans sonu dönemi itibarıyla hesaplanan portföy getiri oranı ile karşılaştırma ölçütünün getiri oranı arasındaki farkı ifade etmektedir.

4. Yönetim ücretleri, vergi, saklama ücretleri ve diğer faaliyet giderlerinin ortalama fon toplam değerine oranı aşağıdaki gibidir.

01.01.2022 - 31.12.2022 döneminde :	Ort. Fon Toplam Değerine Oranı (%)	TL Tutar
Fon Yönetim Ücreti	3.00042	147,334,098.21
Denetim Ücreti	0.00043	20,999.86
Saklama Giderleri	0.01827	897,289.14
İhraç İzni Giderleri	-	-
Noter Harç ve Tasdik Ücretleri	0.02668	1,309,938.15
Diğer Giderler	0.03227	1,584,549.58
Toplam Giderler	3.07807	151,146,874.94
Ortalama Fon Toplam Değeri	4,910,447,694.25	

**YAPI KREDİ PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş. TARAFINDAN KURULAN VE
YÖNETİLEN YAPI KREDİ PORTFÖY EUROBOND (DOLAR)
BORÇLANMA ARAÇLARI FONU**

1 OCAK - 31 ARALIK 2022 DÖNEMİNE AİT PERFORMANS SUNUŞ RAPORU

C. DİPNOTLAR (Devamı)

Fon Net Getiri	-1.11
Gerçekleşen Gider Oranı*	2.24
Azami Gider Oranı	3.65
Kurucu Tarafından Karşılanan Gider Oranı**	-
Net Gider Oranı	2.24
Fon Brüt Getiri	1.13

(*) Fondan A grubu ve B grubu pay sahipleri için farklı yönetim ücreti kesilmekte olup, gerçekleşen gider oranına, B grubu paylara yapılan yönetim ücreti iadelerinin toplam giderden düşülmesi ile ulaşılmaktadır.

(**) Fon'un gerçekleşen gider oranının azami fon toplam gider oranını aşmış olması durumunda, dönem içinde fon toplam gider oranını aşan kısım kurucu tarafından karşılanarak fona ödenmiştir.

- Performans sunum döneminde yatırım stratejisi değişikliği yapılmamıştır.
- Yatırım fonlarının portföy işletmesinden doğan kazançları kurumlar vergisi ve stopajdan muaftır.
- Portföy yönetiminde kullanılan kredi bulunmamaktadır.

D. İLAVE BİLGİLER ve AÇIKLAMALAR

- Getiri Oranını Etkileyen Piyasa Koşulları

01.01.2022 – 31.12.2022 döneminde :	Getiri
BIST 100 Getiri Endeksi	206.50%
BIST 30 Getiri Endeksi	204.16%
BIST-KYD REPO BRÜT ENDEKSİ	14.00%
BIST-KYD DİBS 91 GÜN ENDEKSİ	20.04%
BIST-KYD DİBS 182 GÜN ENDEKSİ	27.06%
BIST-KYD DİBS 365 GÜN ENDEKSİ	35.75%
BIST-KYD DİBS 547 GÜN ENDEKSİ	42.35%
BIST-KYD DİBS TÜM ENDEKSİ	61.69%
BIST-KYD DİBS UZUN ENDEKSİ	103.49%
BIST-KYD ÖSBA SABİT ENDEKSİ	22.49%
BIST-KYD ÖSBA DEĞİŞKEN ENDEKSİ	18.47%
BIST-KYD Kamu Kira Sertifikaları Endeksi	27.06%
BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Mevduat Endeksi (TL)	16.68%
BIST-KYD 1 Aylık Gösterge Kar Payı TL Endeksi	17.16%
BIST-KYD ALTIN FİYAT AĞIRLIKLILIKLI ORTALAMA	40.86%
BIST-KYD Eurobond USD (TL)	44.02%
BIST-KYD Eurobond EUR (TL)	37.81%
Dolar Kuru	40.28%
Euro Kuru	32.14%