

HSBC Portföy Çoklu Varlık İkinci Değişken Fon

**1 Ocak - 31 Aralık 2019 hesap dönemine ait
Pay Fiyatının Hesaplanmasına Dayanak Teşkil Eden
Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık
Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporlarının Mevzuata
Uygun Olarak Hazırlanmasına İlişkin Denetim Raporu**

HSBC Portföy Çoklu Varlık İkinci Değişken Fon'un Pay Fiyatının Hesaplanmasına Dayanak Teşkil Eden Portföy Değeri Tablosu ve Toplam Değer/Net Varlık Değeri Tablosunu İçeren Fiyat Raporlarının Mevzuata Uygun Olarak Hazırlanmasına İlişkin Rapor

HSBC Portföy Çoklu Varlık İkinci Değişken Fon'un pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden portföy değeri tablosu ve toplam değer/net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporlarının 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Esaslarına ilişkin Tebliğ (II-14.2) hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanıp hazırlanmadığını Sermaye Piyasası Kurulu'nun konu hakkındaki düzenleme ve duyuruları çerçevesinde 31 Aralık 2019 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

HSBC Portföy Çoklu Varlık İkinci Değişken Fon'un pay fiyatının hesaplanmasına dayanak teşkil eden portföy değeri tablosu ve toplam değer/net varlık değeri tablosunu içeren fiyat raporları 30 Aralık 2013 tarihli ve 28867 (Mükerrer) sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan "Yatırım Fonlarının Finansal Raporlama Esaslarına ilişkin Tebliğ (II-14.2) hükümlerine ve Sermaye Piyasası Kurulu'nca belirlenen esaslara uygun olarak hazırlanmıştır.

Bu görüş tamamen Sermaye Piyasası Kurulu ve HSBC Portföy Yönetimi Anonim Şirketi'nin bilgisi ve kullanımı için hazırlanmış olup, başka maksatla kullanılması mümkün değildir.

Güney Bağımsız Denetim ve Serbest Muhasebeci Mali Müşavirlik A.Ş.
A member firm of Ernst & Young Global Limited

Fatih Polat, SMMM
Sorumlu Denetçi

22 Nisan 2020
İstanbul, Türkiye

HSBC Portföy Çoklu Varlık İkinci Değişken Fon

31 Aralık 2019 tarihli toplam değer/net varlık değeri tablosu (Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

HPD - HSBC PORTFÖY ÇOKLU VARLIK İKİNCİ DEĞ. FON 02/01/2020 08:55															
HPD - HSBC PORTFÖY ÇOKLU VARLIK İKİNCİ DEĞ. FON 31 Aralık 2019 TARİHLİ GÜNLÜK RAPORUDUR															
MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	NOMİNAL FAİZ ORANI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	REPO TEMİNAT TUTARI	BORSA SÖZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
HİSSE SENETLERİ															
Hisse Türk															
SXSEEX	EUR	ISHARES, INC			11.100,00	35,14	18/10/19				37,82	2.796.762,90	9,30	2,74	2,78
SX7PEX	EUR	ISHARES, INC			1.900,00	18,52	18/10/19				14,36	181.794,05	0,60	0,18	0,18
SYBM	EUR	State StreetBank and Trust Company			10,00	70,06	18/10/19				65,81	4.384,19	0,01		
GRUP TOPLAMI											2.982.941,14		9,91	2,92	2,96
Hisse Türk															
AKBNK	TL	AKBANK T.A.Ş.			220.920,00	7,32	18/10/19				8,11	1.791.661,20	5,96	1,76	1,78
ANHYT	TL	ANADOLU HAYAT EMEKLİLİK A.Ş.			0,74	5,37	18/10/19				6,84	5,03	-	-	-
ARCLK	TL	ARÇELİK A.Ş.			16.200,00	21,00	18/10/19				20,84	337.608,00	1,12	0,33	0,34
ASELS	TL	AŞELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.			18.000,00	20,93	18/10/19				20,94	376.920,00	1,25	0,37	0,37
BIMAS	TL	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.			24.800,00	34,18	18/10/19				46,66	1.157.168,00	3,85	1,13	1,15
ENJSA	TL	ENERJISA ENERJİ A.Ş.			50.000,00	5,84	18/10/19				7,39	369.500,00	1,23	0,36	0,37
ENKAİ	TL	ENKA İNŞAAT VE SANAYİ A.Ş.			0,48	4,90	18/10/19				6,42	3,09	-	-	-
EREGL	TL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.			110.900,00	7,69	18/10/19				9,04	1.002.536,00	3,33	0,98	1,00
GARAN	TL	GARANTİ BANKASI			178.200,00	9,17	18/10/19				11,14	1.985.148,00	6,60	1,95	1,97
GOZDE	TL	GÖZDE GİRİŞİM SERMAYESİ YATIRIM ORT. A.Ş.			0,72	5,50	18/10/19				5,14	3,72	-	-	-
HEKTS	TL	HEKTAŞ TİCARET T.A.Ş.			55.500,00	3,01	04/11/19				8,02	445.110,00	1,48	0,44	0,44
ISCTR	TL	T.İŞ BANKASI A.Ş.			90.000,00	5,90	18/10/19				6,41	576.900,00	1,92	0,57	0,57
ISGYO	TL	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.			2,01	1,30	18/10/19				1,76	3,54	-	-	-
KCHOL	TL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.			41.450,00	15,79	18/10/19				20,32	842.264,00	2,80	0,83	0,84
KOZAL	TL	KOZA ALTIN İŞLETMELERİ A.Ş.			6.950,00	32,40	18/10/19				74,05	514.647,50	1,71	0,50	0,51
KRDMD	TL	KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş. (D)			0,45	5,60	18/10/19				2,66	1,18	-	-	-
PETKM	TL	PETKİM PETROKİMYA HOLDİNG A.Ş.			64.000,00	3,73	18/10/19				3,81	243.840,00	0,81	0,24	0,24
PGSUS	TL	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.			6.000,00	30,78	18/10/19				86,40	518.400,00	1,72	0,51	0,52
SAHOL	TL	HACI ÖMER SABANCI HOLDİNG A.Ş.			51.950,00	10,80	18/10/19				9,54	495.603,00	1,65	0,49	0,49
SISE	TL	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALARI A.Ş.			0,84	8,30	18/10/19				5,27	4,41	-	-	-
SODA	TL	SODA SANAYİİ A.Ş.			30.558,58	6,14	18/10/19				6,18	188.852,02	0,63	0,19	0,19
TCELL	TL	TURKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.Ş.			100.700,00	12,65	18/10/19				13,80	1.389.660,00	4,62	1,36	1,38
THYAO	TL	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.			45.100,00	12,36	18/10/19				14,46	652.146,00	2,17	0,64	0,65
TKFEN	TL	TEKFEN HOLDİNG A.Ş.			20.000,00	21,43	18/10/19				19,32	386.400,00	1,29	0,38	0,38
TOASO	TL	TOFAŞ TÜRK OTOMOBİL FABRİKASI A.Ş.			8.500,00	26,56	18/10/19				26,86	228.310,00	0,76	0,22	0,23
TRKCM	TL	TRAKYA CAM SANAYİİ A.Ş.			0,75	4,06	18/10/19				3,50	2,62	-	-	-
TSKB	TL	T.SINAI KALKINIMA BANKASI A.Ş.			0,33	9,26	18/10/19				1,21	0,39	-	-	-
TTKOM	TL	TÜRK TELEKOMÜNİKASYON A.Ş.			40.000,00	5,43	18/10/19				7,37	294.800,00	0,98	0,29	0,29
TUPRS	TL	TUPRAS-TÜRKİYE PETROL RAFİNELERİ A.Ş.			10.400,00	103,95	18/10/19				126,80	1.318.720,00	4,39	1,29	1,31
VAKBN	TL	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.			40.000,00	4,86	18/10/19				5,51	220.400,00	0,73	0,22	0,22
YKBNK	TL	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.			220.000,32	2,03	18/10/19				2,48	545.600,79	1,81	0,54	0,54
GRUP TOPLAMI											15.882.218,49		52,81	15,59	15,78
Hisse Yabancı															
BSV	USD	VANGUARD GROUP			3.000,00	79,60	18/10/19				80,61	1.436.470,20	4,78	1,41	1,43
EEM	USD	ISHARES, INC			7.650,00	43,97	01/11/19				44,87	2.038.937,67	6,78	2,00	2,03
EMB	USD	ISHARES, INC			2.300,00	114,70	18/10/19				114,56	1.565.118,72	5,21	1,53	1,56
EWJ	USD	ISHARES, INC			2.800,00	61,42	18/10/19				59,24	985.279,68	3,28	0,97	0,98
LEMB	USD	ISHARES, INC			100,00	47,96	18/10/19				43,89	26.070,66	0,09	0,03	0,03
PRF	USD	Invesco PowewrShares Capital Mgmt LLC			500,00	74,87	18/10/19				126,71	376.328,70	1,25	0,37	0,37
SJNK	USD	State StreetBank and Trust Company			1.500,00	26,54	18/10/19				26,94	240.035,40	0,80	0,23	0,24
VCSH	USD	VANGUARD GROUP			900,00	79,59	18/10/19				81,03	433.186,38	1,44	0,42	0,43
VOO	USD	VANGUARD GROUP			590,00	266,90	18/10/19				295,80	1.036.660,68	3,45	1,02	1,03
VWO	USD	VANGUARD GROUP			11.600,00	39,86	18/10/19				44,47	3.064.160,88	10,20	3,00	3,05
GRUP TOPLAMI											11.202.248,97		37,28	10,98	11,15
GRUP TOPLAMI											30.067.408,60		100	29,49	29,89
BORÇLANMA SENETLERİ															
Devlet Tahvili															
TRT170221T12	TL	HAZİNE	17/02/21	6,9188	2.500.000,00	106,45	18/10/19				103,49	2.587.285,89	4,96	2,54	2,57
TRT210421T14	TL	HAZİNE	21/04/21	0	500.000,00	113,91	11/12/19		721979475562394347		115,58	577.888,81	1,11	0,57	0,57
TRT220921T18	TL	HAZİNE	22/09/21	0	10.000.000,00	97,66	02/12/19		721544068958299081		99,31	9.930.977,21	19,02	9,74	9,87
TRT230222T13	TL	HAZİNE	23/02/22	0	50.000,00	124,67	18/10/19				218,93	109.466,14	0,21	0,11	0,11
TRT020322T17	TL	HAZİNE	02/03/22	9,5574	7.700.000,00	104,31	18/10/19				102,93	7.925.490,11	15,19	7,77	7,88
TRT140922T17	TL	HAZİNE	14/09/22	12,4414	180.000,00	91,28	18/10/19				96,51	173.723,85	0,33	0,17	0,17
TRT261022T10	TL	HAZİNE	26/10/22	1,7108	350.000,00	101,79	18/10/19				206,88	724.079,42	1,39	0,71	0,72
TRT270923T11	TL	HAZİNE	27/09/23	8,353	300.000,00	101,86	18/10/19				94,31	282.329,00	0,54	0,28	0,28
TRT200324T13	TL	HAZİNE	20/03/24	9,4908	200.000,00	103,88	18/10/19				99,20	198.409,81	0,38	0,19	0,20
TRT120325T12	TL	HAZİNE	12/03/25	9,8404	400.000,00	93,06	18/10/19				87,97	351.888,79	0,67	0,34	0,35
TRT240227T17	TL	HAZİNE	24/02/27	10,4628	200.000,00	104,02	18/10/19				98,98	197.952,48	0,38	0,19	0,20
GRUP TOPLAMI											23.060.091,51		44,18	22,61	22,92

HSBC Portföy Çoklu Varlık İkinci Değişken Fon

31 Aralık 2019 tarihli toplam değer/net varlık değeri tablosu (Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

HPD - HSBC PORTFÖY ÇOKLU VARLIK İKİNCİ DEĞ. FON 02/01/2020 08:55															
HPD - HSBC PORTFÖY ÇOKLU VARLIK İKİNCİ DEĞ. FON 31 Aralık 2019 TARİHLİ GÜNLÜK RAPORUDUR															
MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	NOMİNAL FAİZ ORANI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	REPO TEMİNAT TUTARI	BORSA SÖZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
Eurobond Türk XS0503454166	EUR	HAZİNE	18/05/20	0,5961	550.000,00	104,83	29/11/19				105,02	3.848.246,75	7,37	3,77	3,83
GRUP TOPLAMI					550.000						3.848.246,75		7,37	3,77	3,83
Eurobond Yabancı XS1622626379	USD	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	30/05/22	6,8218	200.000,00	99,94	18/10/19				100,75	1.196.868,42	2,29	1,17	1,19
GRUP TOPLAMI					200.000						1.196.868,42		2,29	1,17	1,19
Özel Sektör															
Özel Sektör Tahvil															
TRSAKFH12015	TL	AKFEN HOLDİNG A.Ş.	06/01/20	20,0796	1.750.000,00	100,00	18/10/19				104,19	1.823.326,66	3,49	1,79	1,81
TRSO TKO22012	TL	OTOKOÇ OTOMOTIV TIC VE SAN A.Ş.	26/02/20	50,1633	2.000.000,00	100,00	18/10/19				104,88	2.097.562,71	4,02	2,06	2,09
TRSAKFH32013	TL	AKFEN HOLDİNG A.Ş.	19/03/20	10,622	100.000,00	103,24	18/10/19				100,79	100.788,34	0,19	0,10	0,10
TRSKCTF32014	TL	KOÇ FİNANSMAN A.Ş.	23/03/20	17,9126	2.850.000,00	100,00	18/10/19				103,97	2.963.066,52	5,68	2,90	2,95
TRSEVA52010	TL	DEVA HOLDİNG A.Ş.	04/05/20	25,8612	500.000,00	100,00	18/10/19				101,49	507.441,54	0,97	0,50	0,50
TRFTCZB82013	TL	TC ZIRAAT BANKASI	27/08/20	20,916	1.420.000,00	100,00	18/10/19				102,25	1.451.993,64	2,78	1,42	1,44
TRSORFNE2019	TL	ORFİN FİNANSMAN	30/10/20	25,53	1.500.000,00	100,00	18/10/19				102,99	1.544.907,55	2,96	1,51	1,54
TRSTPRS12115	TL	TÜPRAŞ-TÜRKİYE PETROL RAFİNERİLERİ A.Ş.	22/01/21	26,4484	800.000,00	100,00	18/10/19				103,10	824.772,43	1,58	0,81	0,82
TRSIGV12113	TL	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.	25/01/21	26,7368	180.000,00	100,00	18/10/19				103,29	185.915,33	0,36	0,18	0,18
TRSOAP522129	TL	OPET PETROLÇÜLÜK A.Ş.	19/02/21	21,4588	900.000,00	100,00	18/10/19				102,44	921.942,84	1,77	0,90	0,92
TRSMGT12115	TL	MİGROS TİCARET A.Ş.	24/02/21	23,0356	1.000.000,00	100,00	18/10/19				102,16	1.021.619,40	1,96	1,00	1,02
TRSIGV32111	TL	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.	23/03/21	17,508	1.360.000,00	100,00	18/10/19				100,25	1.363.431,65	2,61	1,34	1,36
TR SARCL72112	TL	ARÇELİK A.Ş.	16/07/21	25,7124	1.400.000,00	100,00	18/10/19				102,84	1.439.795,79	2,76	1,41	1,43
TRSO TKO72116	TL	OTOKOÇ OTOMOTIV TIC VE SAN A.Ş.	30/07/21	44,5672	1.450.000,00	100,00	18/10/19				102,45	1.485.535,88	2,85	1,46	1,48
TRSAYGZ82118	TL	AYGAZ A.Ş.	04/08/21	22,012	610.000,00	100,00	18/10/19				102,24	623.683,40	1,20	0,61	0,62
TRSBMKS12230	TL	BİMEKS BİLGİ İŞLEM VE DİŞ TİCARET A.Ş.	11/01/22	0	1.500.000,00	101,92	18/10/19				103,51	1.552.697,10	2,98	1,52	1,54
TRSENSA32314	TL	ENERJISA ENERJİ A.Ş.	30/03/23	5,065	2.000.000,00	100,00	18/10/19				130,65	2.612.962,89	5,01	2,56	2,60
TRSYKBK62914	TL	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	20/06/29	16,5844	1.500.000,00	100,00	18/10/19				104,16	1.562.341,91	2,99	1,53	1,55
GRUP TOPLAMI					22.820.000						24.083.785,58		46,16	23,6	23,95
GRUP TOPLAMI					22.820.000						24.083.785,58		46,16	23,6	23,95
GRUP TOPLAMI					45.950.000						52.188.992,26		100	51,15	51,89
T.R.EPO															
TRT020823T11	TL	HAZİNE	02/01/20	11,25	2.501.541,10	11,25	31/12/19	1.283.775,00	722810706353283733	2.501.541,10	11,38	2.501.541,10	16,13	2,45	2,49
TRT261022T10	TL	HAZİNE	02/01/20	11,25	13.008.013,70	11,25	31/12/19	6.483.910,00	722810706353283734	13.008.013,70	11,38	13.008.013,70	83,87	12,74	12,93
GRUP TOPLAMI					15.509.555						15.509.554,80		100	15,19	15,42
GRUP TOPLAMI					15.509.555						15.509.554,80		100	15,19	15,42
TPP															
TPP															
TPP			02/01/20	10,8	200.118,36	10,80	31/12/19		228524	200.118,36	10,78	200.118,36	15,69	0,20	0,20
GRUP TOPLAMI			03/02/20	17,5	1.085.821,92	17,50	08/08/19			1.085.821,92	11,00	1.075.462,78	84,31	1,05	1,07
GRUP TOPLAMI					1.285.940						1.275.581,14		100	1,25	1,27
GRUP TOPLAMI					1.285.940						1.275.581,14		100	1,25	1,27
TÜREV															
Futures															
Kısa															
F_USDTRY0120	TL				839,00	5,99	30/12/19		80176126522784060		6,00	5.034.587,30	-	-	-
F_XU0300220	TL				353,00	141,30	30/12/19		801701261212515710		141,30	4.987.890,00	-	-	-
F_EURUSD0120	USD				577,00	1,12	31/12/19		80176126523231570		1,12	3.854.088,81	-	-	-
GRUP TOPLAMI					1.769						13.876.566,11		-	-	-
GRUP TOPLAMI					1.769						13.876.566,11		-	-	-
VIOP Nakit															
VIOP Nakit															
Teminatu															
GRUP TOPLAMI					2.976.449,39							2.976.449,39	100,00	2,92	
GRUP TOPLAMI					2.976.449						2.976.449,39		100	2,92	
GRUP TOPLAMI					2.976.449						2.976.449,39		100	2,92	
DİĞER															
Döviz															
EUR	EUR	EU			14.524,62	6,34	31/12/19				6,66	96.764,47	-	-	0,10
USD	USD	FED			24.808,74	5,85	31/12/19				5,94	147.363,92	-	-	0,15
GRUP TOPLAMI					39.333						244.128,39		-	-	0,25
GRUP TOPLAMI					39.333						244.128,39		-	-	0,25
FON PORTFÖY DEĞERİ											102.017.986,19			100,00	

HSBC Portföy
Çoklu Varlık İkinci Değişken Fon

31 Aralık 2019 tarihli toplam değer/net varlık değeri tablosu
(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

31 Aralık 2019			
	Tutar TL	Grup %	Toplam %
Fon portföy değeri	102.017.986	100%	101%
Hazır değerler	259.499	100%	0%
Kasa	-	-	-
Bankalar	15.371	-	-
Diğer hazır değerler	244.128	94%	0,24%
Alacaklar	-	-	0,00%
Takastan alacaklar	-	-	-
Diğer alacaklar	-	-	0,00%
Borçlar	(1.704.465)	100%	-1,69%
Banka kredileri	-	-	-
Ayrılan İhtiyatlar	-	-	-
İhbarlı FonPay Takas	(513)	0,03%	0,00%
Takasa Borçlar	-	0,00%	0,00%
Fon yönetim ücretleri	(121.195)	7,11%	-0,12%
Denetim ücreti	(4.205)	0,25%	0,00%
Diğer borçlar	(1.573.526)	92,32%	-1,56%
Kayda Alma Ücreti	(5.029)	0,30%	0,00%
Fon toplam değeri	100.573.018	100%	100%