

HSBC Portföy Bist 30 Endeksi Hisse Senedi Fonu (Hisse Senedi Yoğun Fon)

**1 Ocak - 31 Aralık 2021 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**



**Building a better
working world**

Güney Bağımsız Denetim ve Şiş. M. M. A. Ş.
Maslak Mah. Eski Büyükdere Cad
Orjin Maslak İş Merkezi No 27
Kat: 2-3-4 Daire: 54-57-59
34485 Sarıyer
İstanbul - Türkiye

Tel: +90 212 315 3000
Fax: +90 212 230 8291
ey.com
Ticaret Sicil No: 479920
Mersis No: 0-4350-3032-000017

HSBC Portföy Bist 30 Endeksi Hisse Senedi Fonu (Hisse Senedi Yoğun Fon)'nun 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 Bist 30 Endeksi Hisse Senedi Fonu (Hisse Senedi Yoğun Fon)'nun 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 2021 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

HSBC Portföy Bist 30 Endeksi Hisse Senedi Fonu (Hisse Senedi Yoğun Fon)'nun 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



30 Mart 2022
İstanbul, Türkiye

HSBC Portföy
Bist 30 Endeksi Hisse Senedi Fonu (Hisse Senedi Yoğun Fon)

31 Aralık 2021 tarihli toplam değer/net varlık değeri tablosu
(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

HBU - HSBC PORTFÖY BİST 30 ENDEKSİ HS SENEDİ FONU 31 Aralık 2021 TARİHLİ GÜNLÜK RAPORUDUR																		
MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	REPO TEMİNAT TUTARI	BORSA SÖZLEŞME NO	NET DÖNÜŞ TUTARI	GÜNLÜK BR DEĞER	TOPLAM DEĞER	GRUP (%)	TOPLAM (FPD GÖRE)	TOPLAM (FTD GÖRE)
HISSE SENETLERİ																		
Hisse Türk																		
AGHOL	TL	AG ANADOLU GRUBU HOLDİNG A.Ş.					0,20	9,300000	18/10/19					39,320000	7,86	0,00	0,00	0,00
AKBNK	TL	AKBANK T.A.Ş.					262.944,04	6,898690	27/12/21			8010051735262231002		7,200000	1.893.197,10	5,51	5,05	5,30
AKBNK	TL	AKBANK T.A.Ş.					5.261,00	7,540224	31/12/21			8010051735262231002		7,200000	37.879,20	0,11	0,10	0,11
ANSGR	TL	ANADOLU ANONİM TÜRK SİGORTA ŞİRKETİ					0,43	1,869159	18/10/19					6,570000	2,81	0,00	0,00	0,00
ARCLK	TL	ARÇELİK A.Ş.					16.427,60	42,226373	27/12/21			8010051735265571002		48,400000	795.095,84	2,32	2,12	2,23
ARCLK	TL	ARÇELİK A.Ş.					329,00	51,750669	31/12/21			8010051735265571002		48,400000	15.923,60	0,05	0,04	0,04
ASELS	TL	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.					57.646,00	20,566628	27/12/21			8010051735266529002		20,880000	1.203.648,48	3,51	3,21	3,37
ASELS	TL	ASELSAN ELEKTRONİK SANAYİ VE TİCARET A.Ş.					1.153,00	21,370850	31/12/21			8010051735266529002		20,880000	24.074,64	0,07	0,06	0,07
AYGAZ	TL	AYGAZ A.Ş.					0,13	10,000000	18/10/19					22,440000	2,98	0,00	0,00	0,00
BIMAS	TL	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.					35.428,00	70,073592	27/12/21			8010051735273655002		61,300000	2.171.736,40	6,32	5,79	6,08
BIMAS	TL	BİM BİRLEŞİK MAĞAZALAR A.Ş.					709,00	57,840987	31/12/21			8010051735273655002		61,300000	43.461,70	0,13	0,12	0,12
DOHOL	TL	DOGAN SİRKETLER GRUBU HOLDİNG A.S.					89.067,39	3,143747	27/12/21			8010051735277641002		2,750000	244.935,33	0,71	0,65	0,69
DOHOL	TL	DOGAN SİRKETLER GRUBU HOLDİNG A.S.					1.782,00	2,615011	31/12/21			8010051735277641002		2,750000	4.900,50	0,01	0,01	0,01
EKGYO	TL	EMLAK KONUT GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI					188.456,00	2,279734	27/12/21			8010051735279233002		2,140000	403.295,84	1,17	1,08	1,13
EKGYO	TL	EMLAK KONUT GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI					3.771,00	2,149313	31/12/21			8010051735279233002		2,140000	8.069,94	0,02	0,02	0,02
ENKA	TL	ENKA İNŞAAT VE SANAYİ A.Ş.					0,35	8,252149	29/05/20					15,060000	5,26	0,00	0,00	0,00
EREGL	TL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.					163.367,94	22,894996	27/12/21			8010051735280339002		28,160000	4.600.441,25	13,39	12,29	12,89
EREGL	TL	EREĞLİ DEMİR VE ÇELİK FABRİKALARI T.A.Ş.					3.269,00	30,836764	31/12/21			8010051735280339002		28,160000	92.055,04	0,27	0,25	0,26
FROTO	TL	FORD OTOMOTİV SANAYİ A.Ş.					6.143,00	233,033537	27/12/21			8010051735282289002		238,100000	1.462.648,30	4,26	3,90	4,10
FROTO	TL	FORD OTOMOTİV SANAYİ A.Ş.					123,00	242,216504	31/12/21			8010051735282289002		238,100000	29.286,30	0,09	0,08	0,08
GARAN	TL	GARANTİ BANKASI					196.040,50	11,124559	27/12/21			8010051735282643002		11,270000	2.209.376,44	6,43	5,90	6,19
GARAN	TL	GARANTİ BANKASI					3.923,00	11,612098	31/12/21			8010051735282643002		11,270000	44.212,21	0,13	0,12	0,12
GUBRF	TL	GÜBRE FABRİKALARI T.A.Ş.					7.146,00	75,398031	27/12/21			8010051735285915002		76,850000	549.170,10	1,60	1,46	1,54
GUBRF	TL	GÜBRE FABRİKALARI T.A.Ş.					143,00	79,890979	31/12/21			8010051735285915002		76,850000	10.989,55	0,03	0,03	0,03
HALKB	TL	T. HALK BANKASI A.Ş.					55.328,00	5,042549	27/12/21			8010051735286573002		4,510000	249.529,28	0,73	0,67	0,70
HALKB	TL	T. HALK BANKASI A.Ş.					1.107,00	4,370136	31/12/21			8010051735286573002		4,510000	4.992,57	0,01	0,01	0,01
HURGZ	TL	HÜRRİYET GAZETECİLİK VE MATBAACILIK A.Ş.					0,52	2,000000	18/10/19					1,780000	0,92	0,00	0,00	0,00
ISCTR	TL	T.İŞ BANKASI A.Ş.					135.652,40	6,983636	27/12/21			8010051735290211002		7,190000	975.340,78	2,84	2,60	2,73
ISCTR	TL	T.İŞ BANKASI A.Ş.					2.715,00	7,559554	31/12/21			8010051735290211002		7,190000	19.520,85	0,06	0,05	0,05
ISGYO	TL	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.					1,42	1,264124	18/10/19					3,030000	4,29	0,00	0,00	0,00
KCHOL	TL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.					54.251,61	28,487557	27/12/21			8010051735266323002		28,380000	1.539.660,72	4,48	4,11	4,31
KCHOL	TL	KOÇ HOLDİNG A.Ş.					1.086,00	28,796160	31/12/21			8010051735266323002		28,380000	30.820,68	0,09	0,08	0,09
KOZAA	TL	KOZA ANADOLU METAL MADENCİLİK					16.605,00	19,340249	27/12/21			8010051735269551002		18,020000	299.222,10	0,87	0,80	0,84
KOZAA	TL	KOZA ANADOLU METAL MADENCİLİK					332,00	17,014187	31/12/21			8010051735269551002		18,020000	5.982,64	0,02	0,02	0,02
KOZAL	TL	KOZA ALTIN İŞLETMELERİ A.Ş.					4.301,00	126,884917	27/12/21			8010051735269939002		115,700000	497.625,70	1,45	1,33	1,39
KOZAL	TL	KOZA ALTIN İŞLETMELERİ A.Ş.					86,00	110,482907	31/12/21			8010051735269939002		115,700000	9.950,20	0,03	0,03	0,03
KRDMO	TL	KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK SANAYİ VE					67.525,67	8,858406	27/12/21			8010051735271101002		9,220000	622.586,65	1,81	1,66	1,74
KRDMO	TL	KARDEMİR KARABÜK DEMİR ÇELİK SANAYİ VE					1.351,00	9,209452	31/12/21			8010051735271101002		9,220000	12.456,22	0,04	0,03	0,03
MGROS	TL	MİGROS TİCARET A.Ş.					0,72	40,153631	02/04/21			8010051-10425571650		37,940000	27,17	0,00	0,00	0,00
PETKM	TL	PETKİM PETROKİMYA HOLDİNG A.Ş.					91.186,88	7,909041	27/12/21			8010051735281983002		7,800000	711.257,70	2,07	1,90	1,99
PETKM	TL	PETKİM PETROKİMYA HOLDİNG A.Ş.					1.825,00	7,663425	31/12/21			8010051735281983002		7,800000	14.235,00	0,04	0,04	0,04
PGSUS	TL	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.					3.582,00	92,106214	27/12/21			8010051735282597002		84,950000	304.290,90	0,89	0,81	0,85
PGSUS	TL	PEGASUS HAVA TAŞIMACILIĞI A.Ş.					71,00	82,008028	31/12/21			8010051735282597002		84,950000	6.031,45	0,02	0,02	0,02
QNBFB	TL	FINANSBANK A.Ş.					0,37	3,369272	18/10/19					39,300000	14,58	0,00	0,00	0,00
SAHOL	TL	HACI ÖMER SABANCI HOLDİNG A.Ş.					97.222,99	13,227559	27/12/21			8010051735285909002		13,230000	1.286.260,17	3,75	3,43	3,60
SAHOL	TL	HACI ÖMER SABANCI HOLDİNG A.Ş.					1.946,00	13,013186	31/12/21			8010051735285909002		13,230000	25.745,58	0,07	0,07	0,07
SASA	TL	SASA POLYESTER SANAYİ A.Ş.					19.604,23	41,045116	27/12/21			8010051735287029002		52,850000	1.036.083,56	3,02	2,76	2,90
SASA	TL	SASA POLYESTER SANAYİ A.Ş.					393,00	60,480967	31/12/21			8010051735287029002		52,850000	20.770,05	0,06	0,06	0,06
SİSF	TL	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALARI A.Ş.					145.958,74	12,160633	27/12/21			8010051735291473002		13,380000	1.952.927,98	5,69	5,21	5,47
SİSE	TL	TÜRKİYE ŞİŞE VE CAM FABRİKALARI A.Ş.					2.921,00	14,063557	31/12/21			8010051735291473002		13,380000	39.082,98	0,11	0,10	0,11
SKBNK	TL	ŞEKERBANK T.A.Ş.					0,77	3,194263	18/10/19					1,010000	0,77	0,00	0,00	0,00
SNGYO	TL	SİNPAŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.					0,45	4,292135	18/10/19					4,270000	1,90	0,00	0,00	0,00
TAVHL	TL	TAV HAVALİMANLARI HOLDİNG A.Ş.					16.957,00	31,408296	27/12/21			8010051735293918002		32,700000	554.493,90	1,61	1,48	1,55
TAVHL	TL	TAV HAVALİMANLARI HOLDİNG A.Ş.					339,00	30,931357	31/12/21			8010051735293918002		32,700000	11.085,30	0,03	0,03	0,03
TCCELL	TL	TURKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.Ş.					115.524,66	18,829500	27/12/21			8010051735294910002		18,460000	2.132.585,28	6,21	5,69	5,97
TCCELL	TL	TURKCELL İLETİŞİM HİZMETLERİ A.Ş.					2.311,00	18,772081	31/12/21			8010051735294910002		18,460000	42.661,06	0,12	0,11	0,12
THYAO	TL	TÜRK HAVA YOLLARI A.O.					67.097,63	18,390417	27/12/21			8010051735296596002						

HSBC Portföy
Bist 30 Endeksi Hisse Senedi Fonu (Hisse Senedi Yoğun Fon)

31 Aralık 2021 tarihli toplam değer/net varlık değeri tablosu
(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

T.REPO																	
TRT190826T19	TL	HAZINE	03/01/22	0	14,52	4	2.002.386,85	14,520000	31/12/21	2.124.665,00	751748203129308913	2.002.386,85	14,160000	2.002.386,85	100,00	5,34	5,61
GRUP TOPLAMI							2.002.386,85							2.002.386,85	100,00	5,34	5,61
GRUP TOPLAMI							2.002.386,85							2.002.386,85	100,00	5,34	5,61
TPP																	
TPP			03/01/22	0	16,50		480.650,96	16,500000	31/12/21		252347	480.650,96	15,230000	480.650,96	100,00	1,28	1,35
GRUP TOPLAMI							480.650,96							480.650,96	100,00	1,28	1,35
GRUP TOPLAMI							480.650,96							480.650,96	100,00	1,28	1,35
TÜREV																	
Futures																	
Uzun																	
F_XU0300222	TL						82,00	2.107,750000	29/12/21		8017012628026255400		2.097,000000	1.719.540,00	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI							82,00							1.719.540,00	0,00	0,00	0,00
GRUP TOPLAMI							82,00							1.719.540,00	0,00	0,00	0,00
VIOP Nakit Teminatı																	
VIOP Nakit Teminatı																	
GRUP TOPLAMI							657.828,71							657.828,71	100,00	1,84	
GRUP TOPLAMI							657.828,71							657.828,71	100,00	1,84	
FON PORTFÖY DEĞERİ														37.481.631,59		100,08	

HSBC Portföy
Bist 30 Endeksi Hisse Senedi Fonu (Hisse Senedi Yoğun Fon)

31 Aralık 2021 tarihli toplam değer/net varlık değeri tablosu
(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

31 Aralık 2021			
	Tutar	Grup	Toplam
	TL	%	%
FON PORTFÖY DEĞERİ	37.481.632		104,99%
HAZIR DEĞERLER	14.594		0,04%
Kasa	0,00	0%	0%
Bankalar	14.594	100%	0,04%
Diğer Hazır Değerler	0,00	0%	0%
ALACAKLAR	535.416		1,5%
Takastan Alacaklar Toplamı	535.416	100%	1,5%
Diğer Alacaklar	0,00		
BORÇLAR	(2.330.773)		-6,53%
Takasa Borçlar	(1.875.907)	80,48%	-5,25%
İhbarlı FonPay Takas	(327.807)		
Yönetim Ücreti	(32.336)	1,39%	-0,09%
Ödenecek Vergi	(884)	0,04	0%
İhtiyatlar	0,00	0%	0%
DİĞER_BORÇLAR	(92.054)	4,06%	-0,26%
Kayda Alma Ücreti	(1.785)	0,08%	-0,01%
Krediler	0,00	0%	0 %
Fon toplam değeri	35.700.869	100	100