

HSBC Portföy Yabancı BYF Fon Sepeti Fonu

**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 Yabancı BYF Fon Sepeti Fonu'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 Yabancı BYF Fon Sepeti Fonu'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 2019 tarihi itibarıyla incelemiş bulunuyoruz.

HSBC Portföy Yabancı BYF Fon Sepeti Fonu'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

Fatih Polat, SMMM
Sorumlu Denetçi

22 Nisan 2020
İstanbul, Türkiye

HSBC Portföy Yabancı BYF Fon Sepeti Fonu

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

HOY - HSBC PORTFÖY YABANCI BYF FON SEPETİ FONU															
02/01/2020 08:55															
HOY - HSBC PORTFÖY YABANCI BYF FON SEPETİ FONU 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 Yabancı															
SX5EEX	EUR	ISHARES, INC			65.345,00	35,16	25/11/19				37,82	16.464.366,84	7,29	6,49	6,46
SX7PEX	EUR	ISHARES, INC			500,00	16,26	18/10/19				14,36	47.840,54	0,02	0,02	0,02
SYBM	EUR	State StreetBank and Trust Company			400,00	70,89	18/10/19				65,81	175.367,79	0,08	0,07	0,07
GRUP TOPLAMI					66.245						16.687.575,17		7,39	6,58	6,55
Hisse Türk															
GLDTR	TL	QNB FİNANS PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.			50.000,00	8,59	18/10/19				26,06	1.302.750,00	0,58	0,51	0,51
GRUP TOPLAMI					50.000						1.302.750,00		0,58	0,51	0,51
Hisse Yabancı															
BIV	USD	VANGUARD GROUP			8.600,00	85,84	17/12/19				87,22	4.455.546,48	1,97	1,76	1,75
BSV	USD	VANGUARD GROUP			51.300,00	80,00	18/10/19				80,61	24.563.640,42	10,86	9,70	9,63
CSPX	USD	ISHARES CORE S&P 500			1.500,00	312,60	03/12/19				320,30	2.853.873,00	1,26	1,13	1,12
DIA	USD	State StreetBank and Trust Company			410,00	257,13	18/10/19				285,10	694.332,54	0,31	0,27	0,27
EEM	USD	ISHARES, INC			35.300,00	41,41	01/11/19				44,87	9.408.431,34	4,17	3,71	3,69
EMB	USD	ISHARES, INC			9.650,00	113,30	09/12/19				114,56	6.566.693,76	2,91	2,59	2,58
EMHY	USD	ISHARES, INC			11.000,00	51,43	18/10/19				47,31	3.091.235,40	1,37	1,22	1,21
EMLC	USD	VanEck Vectors J.P. Morgan EM			33.950,00	34,06	18/10/19				34,01	6.858.558,63	3,04	2,70	2,69
EWJ	USD	ISHARES, INC			27.400,00	58,60	18/10/19				59,24	9.641.665,44	4,27	3,80	3,78
GLD	USD	State StreetBank and Trust Company			2.500,00	125,97	18/10/19				142,90	2.122.065,00	0,94	0,84	0,83
HYG	USD	ISHARES, INC			12.750,00	86,36	18/10/19				87,94	6.660.135,90	2,95	2,63	2,61
IEF	USD	ISHARES, INC			35.150,00	111,75	11/12/19				110,22	23.012.944,02	10,19	9,07	9,03
IEMB	USD	ISHARES, INC			8.300,00	110,75	18/10/19				114,16	5.628.316,32	2,49	2,22	2,21
LEMB	USD	ISHARES, INC			45.350,00	45,54	18/10/19				43,89	11.823.044,31	5,24	4,66	4,64
PHB	USD	Invesco PowewrShares Capital Mgmt LLC			45.000,00	19,23	18/10/19				19,26	5.148.198,00	2,28	2,03	2,02
PXH	USD	Invesco PowewrShares Capital Mgmt LLC			33.500,00	19,05	18/10/19				22,30	4.437.477,00	1,97	1,75	1,74
SHYG	USD	ISHARES, INC			21.700,00	47,64	17/12/19				46,43	5.984.734,14	2,65	2,36	2,35
SJNK	USD	State StreetBank and Trust Company			66.500,00	27,40	17/12/19				26,94	10.641.569,40	4,71	4,20	4,17
SPII	USD	State StreetBank and Trust Company			500,00	28,00	18/10/19				28,55	84.793,50	0,04	0,03	0,03
SPSB	USD	State StreetBank and Trust Company			128.000,00	30,62	18/10/19				30,84	23.448.268,80	10,38	9,25	9,20
SPY	USD	State StreetBank and Trust Company			1.655,00	291,46	03/12/19				321,86	3.164.109,10	1,40	1,25	1,24
VCSH	USD	VANGUARD GROUP			28.100,00	80,25	18/10/19				81,03	13.525.041,42	5,99	5,33	5,30
VOO	USD	VANGUARD GROUP			4.870,00	254,01	11/12/19				295,80	8.556.843,24	3,79	3,37	3,36
VVO	USD	VANGUARD GROUP			22.100,00	39,66	18/10/19				44,47	5.837.754,78	2,59	2,30	2,29
VWO	USD	VANGUARD GROUP			19.900,00	78,59	18/10/19				81,41	9.623.150,46	4,26	3,79	3,77
GRUP TOPLAMI					654.985						207.832.422,40		92,03	81,96	81,51
GRUP TOPLAMI					771.230						225.822.747,57		100,00	89,05	88,57
BORÇLANMA SENETLERİ															
Eurobond Türk															
US900123AX87	USD	HAZİNE	05/06/20	3,4684	1.500.000,00	104,69	05/11/19				102,50	9.132.527,25	53,97	3,60	3,58
XS1867595750	USD	YAPI VE KREDİ BANKASI A.Ş.	15/01/24	0	500.000,00	109,79	18/10/19				119,44	3.547.381,61	20,96	1,40	1,39
US900123CQ19	USD	HAZİNE	24/10/28	6,1238	500.000,00	100,77	09/12/19				102,59	3.046.832,25	18,00	1,20	1,19
GRUP TOPLAMI					2.500.000						15.726.741,11		92,93	6,20	6,16
Eurobond Yabancı															
XS1622626379	USD	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	30/05/22	6,821	200.000,00	99,94	18/10/19				100,75	1.196.868,42	7,07	0,47	0,47
GRUP TOPLAMI					200.000						1.196.868,42		7,07	0,47	0,47
GRUP TOPLAMI					2.700.000						16.923.609,53		100,00	6,67	6,63
T.REPO															
TRT050624T35	TL	HAZİNE	02/01/20	11,25	8.505.239,73	11,25	31/12/19	7.698.095,00	722810706353285307	8.505.239,73	11,38	8.505.239,73	100,00	3,35	3,34
GRUP TOPLAMI					8.505.240						8.505.239,73		100,00	3,35	3,34
GRUP TOPLAMI					8.505.240						8.505.239,73		100,00	3,35	3,34
TPP															
TPP			02/01/20	10,8	140.082,85	10,80	31/12/19		228538	140.082,85	10,78	140.082,85	100,00	0,06	0,05
GRUP TOPLAMI					140.083						140.082,85		100,00	0,06	0,05
GRUP TOPLAMI					140.083						140.082,85		100,00	0,06	0,05
TÜREV															
Futures															
Uzun															
F_USDTRY0120	TL				1.338,00	5,99	30/12/19		80176126522802770		6,00	8.028.936,60	-	-	-
F_USDTRY0220	TL				200,00	6,03	10/12/19		80176126516666790		6,05	1.209.340,00	-	-	-
Kısa															
F_EURUSD1219	USD				16,00	1,12	10/12/19		80176126514075140		1,12	106.596,86	-	-	-
GRUP TOPLAMI					1.554						9.344.873,46		-	-	-
GRUP TOPLAMI					1.554						9.344.873,46		-	-	-
VIOP Nakit															
Teminatl															

HSBC Portföy
Yabancı BYF Fon Sepeti Fonu

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

HOY - HSBC PORTFÖY YABANCI BYF FON SEPETİ FONU
02/01/2020 08:55

HOY - HSBC PORTFÖY YABANCI BYF FON SEPETİ FONU 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)
VIOP Nakit Teminatı					2.211.892,00							2.211.892,00	100,00	0,87	
GRUP TOPLAMI					2.211.892						2.211.892,00		100,00	0,87	
GRUP TOPLAMI					2.211.892						2.211.892,00		100,00	0,87	
DİĞER															
Döviz															
EUR	EUR	EU			8.951,60	6,42	31/12/19				6,66	59.636,45	-	-	0,02
USD	USD	FED			337.883,37	5,88	31/12/19				5,94	2.007.027,24	-	-	0,79
GRUP TOPLAMI					346.835						2.066.663,69		-	-	0,81
GRUP TOPLAMI					346.835						2.066.663,69		-	-	0,81
FON PORTFÖY DEĞERİ											253.603.571,68			100,00	

HSBC Portföy
Yabancı BYF Fon Sepeti Fonu

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	253.603.572	100%	99%
Hazır değerler	2.082.004	100%	1%
Kasa	-	-	-
Bankalar	15.341	-	-
Diğer hazır değerler	2.066.663	99%	0,81%
Alacaklar	-	0%	0,00%
Takastan alacaklar	-	-	-
Diğer alacaklar	-	0%	0,00%
Borçlar	(715.701)	100%	-0,28%
Banka kredileri	-	-	-
Takas Borçları	-	0,00%	0,00%
ihtiyatlı paylar	(224.331)	31,34%	-0,09%
Fon yönetim ücretleri	(433.786)	60,61%	-0,17%
Denetim ücreti	(8.853)	1,24%	0,00%
Diğer borçlar	(35.982)	5,03%	-0,01%
saklama ücreti			
Tahvil Borsa payı			
Kayda Alma Ücreti	(12.748)	1,78%	0,00%
Fon toplam değeri	254.969.875	100%	100%