

HSBC Portföy Orta Vadeli Borçlanma Araçları 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 Orta Vadeli Borçlanma Araçları 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 Orta Vadeli Borçlanma Araçları 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 Orta Vadeli Borçlanma Araçları 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 Orta Vadeli Borçlanma Araçları Fonu

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

HST - HSBC PORTFÖY ORTA VAD. BORÇLANMA ARAÇ. FONU															
02/01/2020 08:55															
HST - HSBC PORTFÖY ORTA VAD. BORÇLANMA ARAÇ. 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)
BORÇLANMA SENETLERİ															
Devlet Tahvili															
TRT080720T19	TL	HAZİNE	08/07/20	23,4754	100.000,00	93,60	16/12/19				104,00	104.001,48	0,53	0,44	0,44
TRT120820T12	TL	HAZİNE	12/08/20	12,5378	500.000,00	112,20	25/10/19		720118827010698113		116,15	580.738,79	2,99	2,45	2,48
TRT160920T25	TL	HAZİNE	16/09/20	15,000027	1.000.000,00	85,65	18/10/19				92,71	927.074,02	4,77	3,91	3,97
TRT071020T23	TL	HAZİNE	07/10/20	12,300145	1.000.000,00	89,13	07/11/19		720633398452382273		92,16	921.589,29	4,74	3,89	3,94
TRT170221T12	TL	HAZİNE	17/02/21	-	2.100.000,00	99,93	20/11/19		721148244772107884		103,49	2.173.320,15	11,18	9,17	9,30
TRT210421T14	TL	HAZİNE	21/04/21	-	2.800.000,00	113,16	03/12/19		721702398632023436		115,58	3.236.177,36	16,63	13,64	13,84
TRT220921T18	TL	HAZİNE	22/09/21	-	1.500.000,00	94,10	21/11/19		721187827191057589		99,31	1.489.646,58	7,66	6,28	6,37
TRT201021T25	TL	HAZİNE	20/10/21	-	1.000.000,00	103,73	03/12/19		721702398632100867		106,44	1.064.438,90	5,47	4,49	4,55
TRT120122T17	TL	HAZİNE	12/01/22	-	1.000.000,00	96,95	17/12/19		722216695196495555		101,17	1.011.702,01	5,20	4,27	4,33
TRT020322T17	TL	HAZİNE	02/03/22	-	500.000,00	101,67	18/12/19		722256552493217609		102,93	514.642,21	2,65	2,17	2,20
TRT170822T15	TL	HAZİNE	17/08/22	15,009	500.000,00	91,99	18/10/19				102,34	511.711,82	2,63	2,16	2,19
TRT180123T10	TL	HAZİNE	18/01/23	11,8768	650.000,00	102,01	05/11/19		720593816033586341		107,67	699.855,28	3,60	2,95	2,99
TRT080323T10	TL	HAZİNE	08/03/23	15,147	100.000,00	79,92	05/11/19				90,58	90.580,87	0,47	0,38	0,39
TRT270923T11	TL	HAZİNE	27/09/23	8,1126	50.954,00	102,67	18/10/19				94,31	48.054,55	0,25	0,20	0,21
TRT240724T15	TL	HAZİNE	24/07/24	11,9902	535.214,00	91,40	05/11/19		720554233615147799		93,97	502.921,49	2,59	2,12	2,15
TRT120325T12	TL	HAZİNE	12/03/25	20,1642	100.000,00	61,61	18/10/19				87,97	87.972,20	0,45	0,37	0,38
TRT110226T13	TL	HAZİNE	11/02/26	-	500.000,00	96,23	19/12/19		721425321701875628		97,98	489.898,23	2,52	2,07	2,10
TRT240227T17	TL	HAZİNE	24/02/27	15,0762	500.274,00	83,51	18/10/19				98,98	495.152,39	2,55	2,09	2,12
TRT110827T16	TL	HAZİNE	11/08/27	-	500.000,00	96,08	20/11/19		721148244772354181		96,77	483.848,14	2,49	2,04	2,07
GRUP TOPLAMI											15.433.325,76		79,37	65,09	66,02
Özel Sektör															
Özel Sektör Tahvil															
TRSAKFH12015	TL	AKFEN HOLDİNG A.Ş.	06/01/20	19,0212	100.000,00	100,22	18/10/19				104,19	104.190,09	0,54	0,44	0,45
TRSAKFH32013	TL	AKFEN HOLDİNG A.Ş.	19/03/20	18,6636	290.000,00	100,00	18/10/19				100,79	292.286,20	1,50	1,23	1,25
TRSEVA52010	TL	DEVA HOLDİNG A.Ş.	04/05/20	25,8612	100.000,00	100,00	18/10/19				101,49	101.488,31	0,52	0,43	0,43
TRSMGT172011	TL	MİGROS TİCARET A.Ş.	16/07/20	18,5928	230.000,00	100,00	18/10/19				103,79	238.723,90	1,23	1,01	1,02
TRSHYTV92015	TL	HAYAT VARLIK YÖNETİMİ A.Ş.	11/09/20	23,9348	250.000,00	100,00	18/10/19				100,62	251.558,91	1,29	1,06	1,08
TRSORFNE2019	TL	ORFİN FINANSMAN	30/10/20	25,53	290.000,00	100,00	18/10/19				102,99	298.682,13	1,54	1,26	1,28
TRSBOLU12115	TL	BOLU ÇİMENTO SANAYİİ A.Ş.	11/01/21	21,1668	200.000,00	100,00	18/10/19				103,91	207.828,77	1,07	0,88	0,89
TRSTPRS12115	TL	TUPRAŞ-TÜRKİYE PETROL RAFİNERİLERİ A.Ş.	22/01/21	26,4484	300.000,00	100,00	18/10/19				103,10	309.289,66	1,59	1,30	1,32
TRISGY12113	TL	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.	25/01/21	26,7368	40.000,00	100,00	18/10/19				103,29	41.314,52	0,21	0,17	0,18
TRSTPRS22114	TL	TUPRAŞ-TÜRKİYE PETROL RAFİNERİLERİ A.Ş.	05/02/21	22,8248	200.000,00	100,00	18/10/19				103,83	207.666,28	1,07	0,88	0,89
TRSOPAS22129	TL	OPET PETROLÇÜLÜK A.Ş.	19/02/21	21,4588	200.000,00	100,00	18/10/19				102,44	204.876,19	1,05	0,86	0,88
TRSMGT12115	TL	MİGROS TİCARET A.Ş.	24/02/21	23,0356	200.000,00	100,00	18/10/19				102,16	204.323,88	1,05	0,86	0,87
TRSOtko32110	TL	OTOKOÇ OTOMOTİV TİC. VE SAN. A.Ş.	15/03/21	40,1864	150.000,00	100,00	18/10/19				100,72	151.075,52	0,78	0,64	0,65
TRISGY32111	TL	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.	23/03/21	17,508	220.000,00	100,00	18/10/19				100,25	220.555,12	1,13	0,93	0,94
TRSENSA32314	TL	ENERJİSA ENERJİ A.Ş.	30/03/23	5,065	200.000,00	100,00	18/10/19				130,65	261.296,29	1,34	1,10	1,12
TRSAEST91812	TL	AE ARMA ELEKTROPANÇ ELEKTROMEKANİK	28/09/23	1,6515	300.000,00	100,00	18/10/19				100,00	300.000,00	1,54	1,26	1,28
TRSTISB72712	TL	T.İŞ BANKASI A.Ş.	27/07/27	19,2656	400.000,00	100,00	18/10/19				102,23	408.931,84	2,10	1,73	1,75
TRSVKFB92719	TL	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	06/09/27	18,5604	210.000,00	100,20	18/10/19				100,25	210.525,86	1,08	0,89	0,90
GRUP TOPLAMI											4.014.613,47		20,63	16,93	17,18
GRUP TOPLAMI											4.014.613,47		20,63	16,93	17,18
GRUP TOPLAMI											19.447.939,23		100	82,02	83,2
T.REPO															
TRT070727T13	TL	HAZİNE	02/01/20	11,25	1.500.924,66	11,25	31/12/19	1.148.175,00	722810706353281143	1.500.924,66	11,38	1.500.924,66	37,50	6,33	6,42
TRT120325T12	TL	HAZİNE	02/01/20	11,25	2.501.541,10	11,25	31/12/19	2.934.740,00	722810706353281144	2.501.541,10	11,38	2.501.541,10	62,50	10,55	10,70
GRUP TOPLAMI											4.002.465,76		100	16,88	17,12
GRUP TOPLAMI											4.002.465,76		100	16,88	17,12
TPP															
TPP			02/01/20	10,8	260.153,86	10,80	31/12/19		228514	260.153,86	10,78	260.153,86	100,00	1,10	1,11
GRUP TOPLAMI											260.153,86		100	1,1	1,11
GRUP TOPLAMI											260.153,86		100	1,1	1,11
FON PORTFÖY DEĞERİ											23.710.558,85			100	

HSBC Portföy
Orta Vadeli Borçlanma Araçları 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	23.710.559	100%	101%
Hazır değerler	19.066	100%	0%
Kasa	-	-	-
Bankalar	19.066	-	-
Diğer hazır değerler	-	0%	0,00%
Alacaklar	-	-	0,00%
Takastan alacaklar	-	-	-
Diğer alacaklar	-	-	0,00%
Borçlar	(348.280)	100%	-1,49%
Banka kredileri	-	-	-
İhbarlı FonPay Takas	(300.000)	86,14%	-1,28%
Takasa Borçlar	-	0,00%	0,00%
Fon yönetim ücretleri	(43.013)	12,35%	-0,18%
Denetim ücreti	(540)	0,16%	0,00%
Diğer borçlar	(3.558)	1,02%	-0,02%
Kayda Alma Ücreti	(1.169)	0,34%	-0,01%
Fon toplam değeri	23.381.345	100%	100%