

Temmuz 2020 Portföy Dağılım Raporu

1- FONU TANITICI BİLGİLER				
A. FONUN ADI:	QNB FİNANS PORTFÖY BİRİNCİ DEĞİŞKEN FON			
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	QNB FİNANS PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.			
C. YÖNETİCİ ÜNVANI	QNB FİNANS PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.			
D. FON TUTARI	0			
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	795,703,417.16			
F. DOLAŞIMDAKİ PAY:	34,039,969,280.04			
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	21/08/2006			
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ			
2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER				
A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	0.023376			
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	0.022922			
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	1.98%			
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	12.04%			
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	21.47%			
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ				
MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:				
Hisse Senedi	9.22%			
Varant				
Devlet Tahvili	2.42%			
Özel Sektör Tahvili	0.09%			
Finansman Bonosu	9.45%			
Banka Bonosu	15.45%			
Hazine Bonosu				
Devlet Tahvili Repo	20.13%			
Kuponlar Repo				
Hazine Bonosu Repo				
Varlığa Dayalı Menkuller				
Kira Sertifikaları				
Katılım Hesabı				
Katılma Belgesi	0.03%			
GES				
GOS				
Borsa Para Piyasası	0.04%			
Kıymetli Madenler	8.46%			
VOB İşlemleri				
VOB Nakit Teminat İşlemleri	2.51%			
Yabancı Sabit Getirililer				
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)	12.07%			
Opsiyon				
Swap				
Yabancı Hisse Senetleri	14.00%			
Vadeli Mevduat TL	6.14%			
Vadeli Mevduat Döviz				
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	30.13%			
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:				
Hisse Senedi	20.75%			
Devlet Borçlanma Senetleri	28.53%			
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	182.992			
J. AYLIK KORELASYON :				
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON :				
L. AYLIK TAKİP HATASI :				
M. AYLIK TAKİP HATASI(Yıllıklandırılmış) :				
N. AYLIK TAKİP FARKI :				
O. GEÇEN AYKİ TAKİP HATASI :				
P. GEÇEN AYKİ TAKİP HATASI(Yıllıklandırılmış) :				
R. GEÇEN AYKİ TAKİP FARKI :				
S. KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN				
KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ:	201,504,886.53			
T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN				
KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	30,725,188.72			
3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:				
	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%	
A) HİSSE SENETLERİ				
AKGRT	382,500.00	2,884,050.00	0.39%	
AKSEN	60,000.00	328,800.00	0.04%	
ALKIM	0.94	12.51	0.00%	
ARCLK	311,000.00	7,177,880.00	0.96%	
BIMAS	54,800.00	3,915,460.00	0.53%	
CCOLA	61,700.00	2,753,054.00	0.37%	
FROTO	37,800.00	3,137,400.00	0.42%	
GARAN	1,220,000.00	8,564,400.00	1.15%	

ISMEN	453,405.00	3,581,899.50	0.48%
KCHOL	215,000.00	3,476,550.00	0.47%
KERTV	49,840.00	268,139.20	0.04%
KOZAL	85,000.00	7,348,250.00	0.99%
SAHOL	412,000.00	3,452,560.00	0.46%
TCELL	77,000.00	1,144,220.00	0.15%
TOASO	224,000.00	5,694,080.00	0.76%
TTKOM	311,000.00	2,251,640.00	0.30%
YATAS	95,000.00	856,900.00	0.11%
YKBNK	965,000.42	2,065,100.89	0.28%
TOPLAM :	5,015,046.36	58,900,396.10	7.90%
B) VARANTLAR:			
C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:			
TRT071020T23	6,500,000.00	6,403,480.20	0.86%
TRT160920T25	8,280,000.00	8,199,103.57	1.10%
TRT240724T15	1,000,000.00	912,693.30	0.12%
TOPLAM :	15,780,000.00	15,515,277.07	2.08%
D) BANKA BONOLARI:			
TRFDZBKE2014	20,000,000.00	19,666,874.00	2.64%
TRFTEBK32115	40,000,000.00	40,628,900.00	5.45%
TRFYKBK12130	22,000,000.00	21,052,475.40	2.82%
TRFYKBK82067	25,000,000.00	24,943,415.00	3.35%
TOPLAM :	107,000,000.00	106,291,664.40	14.26%
E) FİNANSMAN BONOLARI:			
TRFFNBK82052	27,000,000.00	26,842,141.80	3.60%
TOPLAM :	27,000,000.00	26,842,141.80	3.60%
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:			
TRFDGOZ71915	17,760.00	19,323.95	0.00%
TRFDGOZ71915	-17,760.00	-19,323.95	0.00%
TRSAKYP41612	-342,500.00	-347,145.57	-0.05%
TRSAKYP41612	342,500.00	347,145.57	0.05%
TRSAKCL22117	260,000.00	268,718.92	0.04%
TRSAYNS21711	-400,000.00	-412,169.64	-0.06%
TRSAYNS21711	400,000.00	412,169.64	0.06%
TRSAYNS51619	70,000.00	70,190.32	0.01%
TRSAYNS51619	-70,000.00	-70,190.32	-0.01%
TRSAYNSK1619	-80,000.00	-82,477.32	-0.01%
TRSAYNSK1619	80,000.00	82,477.32	0.01%
TRSTPRS12115	300,000.00	299,609.52	0.04%
TOPLAM :	560,000.00	568,328.44	0.08%
G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:			
H) GELİRE ENDEKSİ SENETLER:			
I) KİRA SERTİFİKALARI:			
J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:			
K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:			
XS1508914691	1,000,000.00	7,060,474.04	0.95%
XS1605397394	3,900,000.00	26,881,386.39	3.61%
XS1711581337	4,883,000.00	32,859,133.40	4.41%
XS1760780731	600,000.00	4,068,501.31	0.55%
XS2100270508	965,000.00	6,394,622.86	0.86%
XS2112797290	24,000.00	157,935.07	0.02%
US4642874402 - IEF UP	28,200.00	23,944,016.35	3.21%
US4642874402 - IEF UP	20,780.00	17,643,853.18	2.37%
US46428Q1094 - SLV US EQUITY	74,000.00	11,547,871.24	1.55%
US46428Q1094 - SLV US EQUITY	64,300.00	10,034,163.79	1.35%
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF	2,030.00	4,185,534.99	0.56%
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF	1,879.00	3,874,197.17	0.52%
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF	3,590.00	7,402,005.23	0.99%
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF	9,412.00	19,406,037.12	2.60%
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF	2,850.00	5,876,243.71	0.79%
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF	3,540.00	7,298,913.24	0.98%
TOPLAM :	11,582,581.00	188,634,889.09	25.30%
L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:			
ALTIN	135	58,748,446.49	7.88%
TOPLAM :	135	58,748,446.49	7.88%
M) KATILIM HESAPLARI:			
N) KATILMA BELGELERİ:			
IAG	110,000.00	169,983.66	0.02%

TOPLAM :	110,000.00	169,983.66	0.02%
O) VOB İŞLEMLERİ:			
P) OPSİYON İŞLEMLERİ:			
R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:			
TL	16,112,500.35	16,112,500.35	2.16%
TOPLAM :	16,112,500.35	16,112,500.35	2.16%
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:			
T) DİĞER:			
VL Vadeli Mevduat TL	9,282,869.66	9,278,581.31	1.24%
VL Vadeli Mevduat TL	10,319,348.44	10,312,196.87	1.38%
VL Vadeli Mevduat TL	13,744,695.08	13,619,641.09	1.83%
VL Vadeli Mevduat TL	10,407,556.46	10,312,864.91	1.38%
RRP TRT080328T15	3,003,534.25	3,003,534.25	0.40%
RRP TRT080328T15	3,003,534.25	3,003,534.25	0.40%
RRP TRT080328T15	3,003,534.25	3,003,534.25	0.40%
RRP TRT080530T19	17,020,027.40	17,020,027.40	2.28%
RRP TRT080530T19	17,020,027.40	17,020,027.40	2.28%
RRP TRT080530T19	17,020,027.40	17,020,027.40	2.28%
RRP TRT100124T17	8,009,424.66	8,009,424.66	1.07%
RRP TRT100124T17	8,009,424.66	8,009,424.66	1.07%
RRP TRT110226T13	20,023,424.66	20,023,424.66	2.69%
RRP TRT110226T13	20,023,424.66	20,023,424.66	2.69%
RRP TRT110226T13	20,023,424.66	20,023,424.66	2.69%
RRP TRT110226T13	20,023,424.66	20,023,424.66	2.69%
RRP TRT120325T12	12,014,136.99	12,014,136.99	1.61%
RRP TRT120325T12	12,014,136.99	12,014,136.99	1.61%
RRP TRT210721T11	8,510,013.70	8,510,013.70	1.14%
RRP TRT230222T13	18,521,794.52	18,521,794.52	2.48%
RRP TRT230222T13	11,513,547.95	11,513,547.95	1.54%
RRP TRT261022T10	9,511,126.71	9,511,126.71	1.28%
RRP TRT270923T11	1,501,767.12	1,501,767.12	0.20%
BPP	454,500.64	454,500.64	0.06%
TOPLAM :	273,978,727.17	273,747,541.71	36.72%
FON PORTFÖY DEĞERİ	457,138,989.88	745,531,169.11	
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:			
	Tutarı	%	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	745,531,169.11	93.69%	
B. HAZİR DEĞERLER (+) :	54,208,688.49	6.81%	
C. ALACAKLAR (+) :	53,460.90	0.01%	
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0	0.00%	
E. BORÇLAR (-) :	4,089,901.34	0.51%	
FON TOPLAM DEĞERİ:	795,703,417.16		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER			
Açıklama	Tutarı		
37001Fon Yönetim Ücreti	1,318,386.84		
37002Denetim Ücreti	299.88		
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	537.98		
3700320/N RRP Tahvil Borsa Payı	16,308.60		
370033Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	23,343.60		
37004Aracılık Komisyonu	40,756.05		
37005Vergi, Resim ve Harçlar	58.8		
37006Saklama Giderleri	23,800.00		
37008Banka Masrafları	362.25		
370142BİST Endeks K. Öltüçü Kullanım bedeli	629.68		
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	115.95		
37021Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	13,317.58		
37025Döviz Alım Kambiyo Vergisi	685,958.00		
37033KAP Ücreti	346.46		
37045Fon Saklama Ücreti	69,204.38		
37056Vergi Beyannameleri Smm Ödemesi	591.6		
37098Küsürat farkları	0.13		
37099Diğer Giderler	530.47		
TOPLAM	2,194,548.25		
6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMİ. TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR			
Açıklama	Nominal Değeri		
VOO US EQUITY Tem:%100	23,301.00		
IEF UP Tem:%4	48,980.00		

TTKOM Tem:%17	311,000.00			
7- İTİFALAR				
Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal Değeri		
TRFAKYM72017	01/07/2020	10,000,000.00		
TRFAKBK72050	02/07/2020	20,000,000.00		
TRFFIBA72039	08/07/2020	20,000,000.00		
TRFGRAN72066	30/07/2020	30,000,000.00		
TOPLAM :			0	0