

Temmuz 2021 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	0.00			
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	940,423,091.35			
F. DOLAŞIMDAKİ PAY:	33,551,831,071.04			
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	21/08/2006			
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ			
2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER				
A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	0.028029			
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	0.028063			
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	-0.12%			
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	10.09%			
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	19.91%			
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ				
MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:				
Hisse Senedi	2.22%			
Varant				
Devlet Tahvili	0.24%			
Özel Sektör Tahvili	0.00%			
Finansman Bonosu	0.0202			
Banka Bonosu				
Hazine Bonosu				
Devlet Tahvili Repo	43.89%			
Kuponlar Repo				
Hazine Bonosu Repo				
Varlığa Dayalı Menkuller				
Kira Sertifikaları	0.01%			
Katılım Hesabı				
Katılma Belgesi	1.69%			
GES				
GOS				
Borsa Para Piyasası	0.05%			
Kıymetli Madenler	0.0659			
VOB İşlemleri				
VOB Nakit Teminat İşlemleri	0.0438			
Yabancı Sabit Getiriliiler				
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	0.13			
Opsiyon				
Swap				
Yabancı Hisse Senetleri	18.01%			
Vadeli Mevduat TL	1.20%			
Vadeli Mevduat Döviz	6.37%			
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	0.34			
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:				
Hisse Senedi	-			
Devlet Borçlanma Senetleri	0.49			
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	130.80			
J. AYLIK KORELASYON :				
K. ÜÇ AYLIK KORELASYON :				
L. AYLIK TAKİP HATASI :				
M. AYLIK TAKİP HATASI(Yıllıklandırılmış) :				
N. AYLIK TAKİP FARKI :				
O. GEÇEN AYKI TAKİP HATASI :				
P. GEÇEN AYKI TAKİP HATASI(Yıllıklandırılmış) :				

EWG US EQUITY	iShares MSCI Germany ETF		US4642868065	0.00%	65,000.00	36.07834	02/06/2021	0.00%		34.605	8.4139	18,925,595.62
IEF UP	iShares 7-10 Year Treasury Bond ETF		US4642874402	0.00%	46,450.00	116.41722	06/07/2021	0.00%		117.685	8.4139	45,994,317.21
LQD US EQUITY	iShares iBoxx \$ Investment Grade Corporate Bond ETF		US4642872422	0.00%	16,900.00	135.09509	06/07/2021	0.00%		136.025	8.4139	19,342,062.63
SPY US EQUITY	SPDR S&P 500 ETF		US78462F1030	0.00%	2,900.00	382.3599	02/02/2021	0.00%		438.87	8.4139	10,708,564.05
SPY US EQUITY	SPDR S&P 500 ETF		US78462F1030	0.00%	2,250.00	382.9897	04/03/2021	0.00%		438.87	8.4139	8,308,368.66
SPY US EQUITY	SPDR S&P 500 ETF		US78462F1030	0.00%	2,950.00	406.39864	05/04/2021	0.00%		438.87	8.4139	10,893,194.46
SPY US EQUITY	SPDR S&P 500 ETF		US78462F1030	0.00%	2,970.00	420.87	02/06/2021	0.00%		438.87	8.4139	10,967,046.63
			US78462F1030		11,070.00							40,877,173.80
TIP US EQUITY	iShares TIPS Bond ETF		US4642871762	0.00%	18,720.00	128.19984	06/07/2021	0.00%		130.495	8.4139	20,554,033.60
USO US EQUITY	United States Oil Fund		US91232N2071	0.00%	16,800.00	45.10937	05/05/2021	0.00%		50.665	8.4139	7,161,676.09
USO US EQUITY	United States Oil Fund		US91232N2071	0.00%	28,645.00	46.66715	02/06/2021	0.00%		50.665	8.4139	12,211,084.03
			US91232N2071		45,445.00							19,372,760.12
GRUP TOPLAMI					203,585.00							165,065,942.98
F.TERS REPO												
TERS REPO-DT	T.C.	02/08/2021	TRT280628T18	19.11%	4,006,282.74	153.988	30/07/2021	0.00%	2,597,610.00	154.22957		4,006,282.74
	T.C.	02/08/2021	TRT280628T18	19.11%	5,007,853.42	153.988	30/07/2021	0.00%	3,247,010.00	154.229689		5,007,853.42
	T.C.	02/08/2021	TRT050527T17	19.00%	11,017,178.08	99.324	30/07/2021	0.00%	11,074,880.00	99.478984		11,017,178.08
	T.C.	02/08/2021	TRT110827T16	19.00%	11,017,178.08	77.341	30/07/2021	0.00%	14,222,690.00	77.461986		11,017,178.08
	T.C.	02/08/2021	TRT280628T18	19.11%	13,020,418.90	153.988	30/07/2021	0.00%	8,442,215.00	154.22989		13,020,418.90
	T.C.	02/08/2021	TRT140126T11	19.00%	21,032,794.52	193.109	30/07/2021	0.00%	10,874,665.00	193.410965		21,032,794.52
	T.C.	02/08/2021	TRT280628T18	19.10%	45,070,643.84	153.988	30/07/2021	0.00%	29,223,015.00	154.229958		45,070,643.84
	T.C.	02/08/2021	TRT280628T18	19.11%	46,072,251.51	153.988	30/07/2021	0.00%	29,872,440.00	154.229957		46,072,251.51
	T.C.	02/08/2021	TRT280628T18	19.11%	37,058,115.34	153.988	30/07/2021	0.00%	24,027,835.00	154.229939		37,058,115.34
	T.C.	02/08/2021	TRT140126T11	19.00%	24,037,479.45	193.109	30/07/2021	0.00%	12,428,190.00	193.410943		24,037,479.45
	T.C.	02/08/2021	TRT110226T13	19.00%	26,040,602.74	80.87	30/07/2021	0.00%	32,150,480.00	80.996		26,040,602.74
	T.C.	02/08/2021	TRT050527T17	19.00%	29,045,287.67	99.324	30/07/2021	0.00%	29,197,410.00	99.478987		29,045,287.67
	T.C.	02/08/2021	TRT041126T11	19.00%	39,060,904.11	100.144	30/07/2021	0.00%	38,944,075.00	100.299992		39,060,904.11
	T.C.	02/08/2021	TRT050527T17	19.00%	39,060,904.11	99.324	30/07/2021	0.00%	39,265,480.00	99.478993		39,060,904.11
	T.C.	02/08/2021	TRT280628T18	19.11%	45,070,680.82	153.988	30/07/2021	0.00%	29,223,040.00	154.229953		45,070,680.82
GRUP TOPLAMI					395,618,575.33				314,791,035.00			395,618,575.33
G.KATILIM HESABI												
H.VADELİ MEVDUAT												
VADELİ DÖVİZ MEVDUATI	FINANSBANK A.Ş.	31/08/2021		1.50%	2,307,643.50	100	27/07/2021	0.00%		100.0246	8.4139	19,421,066.38
	ANADOLUBANK A.Ş	31/08/2021		1.50%	2,308,426.19	100	27/07/2021	0.00%		100.0246	8.4139	19,427,653.45
	DENİZBANK USD	31/08/2021		0.90%	2,305,655.73	100	27/07/2021	0.00%		100.0148	8.4139	19,402,425.80
VADELİ TL MEVDUATI	ANADOLU BANK A.	10/08/2021		19.00%	11,106,352.51	100	09/07/2021	0.00%		101.2467		11,244,818.93
GRUP TOPLAMI					18,028,077.93							69,495,964.56
I.KIYMETLİ MADEN												
KIYMETLİ MADEN			ALTIN	0.00%	124	485,853.57	03/06/2021	0.00%		492,227.37		61,036,193.82
GRUP TOPLAMI					124							61,036,193.82
J.YABANCI TAHVİL												
K.BORSA PARA PİYASASI												
BPP		02/08/2021		19.25%	80,126.58	100,000.00	30/07/2021	0.00%		100,158.23		80,126.58
GRUP TOPLAMI					80,126.58							80,126.58
L.VARANT İŞLEMLERİ												
M.TEMİNAT İŞLEMLERİ												
VOB Nakit					41,661,445.95	1	07/07/2011			1		41,661,445.95
GRUP TOPLAMI					41,661,445.95							41,661,445.95

N.SWAP İŞLEMLERİ												
O.EUROBOND REPO												
FON												
PORTFÖY												
DEĞERİ					512,189,642.15				314,791,035.00			903,555,489.82
VOB SÖZLEŞMESİ												
Kısa Pozisyon	Kısa	31/08/2021	F_XU0300821		-2,240.00	1514.8958	30/06/2021			1521	1	- 34,070,400.00
TOPLAM					-2,240.00							- 34,070,400.00
GRUP TOPLAMI					2,240.00							34,070,400.00
	FINANSBANK A.Ş. VADELİ		USD		2,308,212.17						8.4139	19,421,066.38
	TAKASBANK A.Ş. VADESİZ USD		USD		17,250.00						8.4139	145,139.77
	DENİZBANK USD		USD		2,305,996.72						8.4139	19,402,425.80
	ANADOLUBANK A.Ş MEV.USD		USD		2,308,995.05						8.4139	19,427,653.45
	FINANS YATIRIM - VADESİZ DÖVİZ		USD		6,046,848.13						8.4139	50,877,575.48
			USD		12,987,302.07							109,273,860.89
	FINANSBANK A.Ş.VADESİZ EURO		EUR		5,464.57						10.0084	54,691.60
GRUP TOPLAMI												109,328,552.49
DÖVİZ BAKİYELERİ												

FON PORTFÖY DEĞERİ	512,383,275.96	903,555,489.82	
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:			
	Tutarı	%	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	903,555,489.82	96.08%	
B. HAZİR DEĞERLER (+) :	51,085,521.91	5.43%	
C. ALACAKLAR (+) :	-	0.00%	
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	-	0.00%	
E. BORÇLAR (-) :	14,217,920.38	1.51%	
FON TOPLAM DEĞERİ:	940,423,091.35		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER			
Açıklama	Tutarı		
37001Fon Yönetim Ücreti	1,699,526.18		
37002Denetim Ücreti	1,448.32		
3700315GMK Tahvil Borsa Payı	579.70		
3700320/N RRP Tahvil Borsa Payı	37,942.80		
370033Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	71,878.80		
37004Aracılık Komisyonu	143,657.25		
37005Vergi, Resim ve Harçlar	64.10		
37006Saklama Giderleri	22,400.00		
370142BİST Endeks K. Öttüçü Kullanım bedeli	1,132.80		
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	178.83		
37021Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	17,167.34		
37023VOB İşlemi Komisyonu	7,074.06		
370281YH Komisyon Giderleri	3,865.80		
37033KAP Ücreti	443.84		
37045Fon Saklama Ücreti	67,122.76		
37056Vergi Beyannameleri Sımm Ödemesi	521.60		
37098Küsürat farkları	0.05		
37099Diğer Giderler	44.25		
TOPLAM	2,075,048.48		
6. A -GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMİ. TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR			
Açıklama	Nominal Değeri		
B-GEÇEN AY İÇİNDE YATIRIM FONLARINA İLİŞKİN MEVZUATTA MEYDANA GELEN DEĞİŞİME VE HUKUKİ İHTİLAFLARLA İLGİLİ			
Açıklamalar			

7- İTFAALAR				
Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal Değeri		
TRFVFAS72119	01/07/2021	5,880,000.00		
TRDZKVK72118	06/07/2021	70,000.00		