

Şubat 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:	587,351,987.22			
F. DOLAŞIMDAKİ PAY:	28,005,952,482.04			
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	21/08/2006			
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ			
2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER				
A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	0.020972			
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	0.02105			
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	-0.37%			
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	0.52%			
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	17.71%			
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ				
MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:				
Hisse Senedi	20.42%			
Varant				
Devlet Tahvili	2.94%			
Özel Sektör Tahvili	0.10%			
Finansman Bonosu	0.74%			
Banka Bonosu				
Hazine Bonosu				
Devlet Tahvili Repo	54.02%			
Kuponlar Repo				
Hazine Bonosu Repo				
Varlığa Dayalı Menkuller				
Kira Sertifikaları	0.08%			
Katılım Hesabı				
Katılma Belgesi	0.03%			
GES				
GOS				
Borsa Para Piyasası	0.05%			
Kıymetli Madenler	0.82%			
VOB İşlemleri				
VOB Nakit Teminat İşlemleri	2.56%			
Yabancı Sabit Getirililer				
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	11.00%			
Opsiyon				
Swap				
Yabancı Hisse Senetleri	7.23%			
Vadeli Mevduat TL	0.00%			
Vadeli Mevduat Döviz				
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	25.47%			
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:				
Hisse Senedi	104.81%			
Devlet Borçlanma Senetleri	190.13%			
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	621.138			
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:	173,607,634.16			
T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN				
KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	53,145,418.88			
3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:				
	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%	
A) HİSSE SENETLERİ				
AKBNK	921,000.00	6,225,960.00	1.05%	
AKSEN	661,000.00	2,346,550.00	0.40%	
ALKIM	46,566.00	2,286,390.60	0.39%	
ASELS	199,200.00	5,478,000.00	0.93%	
EREGL	520,000.00	4,290,000.00	0.73%	
GARAN	530,000.00	5,035,000.00	0.85%	
GLDTR	1,935,000.00	56,412,990.00	9.54%	
KCHOL	130,000.00	2,236,000.00	0.38%	

KERVİT	890,000.00	2,999,300.00	0.51%
KOZAL	35,000.00	2,555,000.00	0.43%
MPARK	90,500.00	1,347,545.00	0.23%
MPARK	469	6,983.41	0.00%
MPARK	1,000.00	14,890.00	0.00%
MPARK	5,000.00	74,450.00	0.01%
MPARK	11,174.00	166,380.86	0.03%
OTKAR	26,089.00	3,939,439.00	0.67%
TOASO	95,000.00	2,523,200.00	0.43%
ULKER	50,000.00	1,024,000.00	0.17%
VAKBN	300,000.00	1,590,000.00	0.27%
YATAS	269,392.00	2,052,767.04	0.35%
YATAS	25,899.00	197,350.38	0.03%
YKBNK	0.42	0.95	0.00%
TOPLAM :	6,742,289.42	102,802,197.24	17.39%
B) VARANTLAR:			
C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:			
TRT080328T15	3,000,000.00	3,090,790.50	0.52%
TRT110226T13	7,000,000.00	6,350,250.90	1.07%
TRT110827T16	5,000,000.00	4,440,891.00	0.75%
TRT160920T25	280,000.00	263,581.22	0.04%
TRT240227T17	5,000,000.00	4,840,937.50	0.82%
TRT240724T15	3,000,000.00	2,644,272.30	0.45%
TOPLAM :	23,280,000.00	21,630,723.42	3.66%
D) BANKA BONOLARI:			
E) FİNANSMAN BONOLARI:			
TRFDZBK32015	100,000.00	102,926.34	0.02%
TRFFNBK42015	20,000.00	19,764.96	0.00%
TRFFNYM32014	2,000,000.00	1,990,195.20	0.34%
TRFFNYM42021	40,000.00	39,514.54	0.01%
TOPLAM :	2,160,000.00	2,152,401.04	0.36%
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	-0.06%
TRSAKYP41612	342,500.00	347,145.57	0.06%
TRSARCL22117	260,000.00	263,909.07	0.04%
TRSAYNS21711	-400,000.00	-412,169.64	-0.07%
TRSAYNS21711	400,000.00	412,169.64	0.07%
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	303,428.70	0.05%
TOPLAM :	560,000.00	567,337.77	0.10%
G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:			
H) GELİRE ENDEKSİ SENETLER:			
I) KİRA SERTİFİKALARI:			
TRDHVKA62043	200,000.00	201,412.00	0.03%
TRDVVRK42057	140,000.00	141,089.14	0.02%
TRDZKVK42012	450,000.00	458,190.90	0.08%
TRDZKVK42020	260,000.00	263,622.40	0.04%
TOPLAM :	1,050,000.00	1,064,314.44	0.18%
J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:			
K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:			
US900123CK49	500,000.00	2,990,268.64	0.51%
US900123CW86	1,000,000.00	6,328,191.54	1.07%
XS1578203462	1,500,000.00	9,399,178.97	1.59%
XS1605397394	5,000,000.00	31,232,538.65	5.28%
XS1613091500	5,150,000.00	32,491,751.82	5.50%
XS1711581337	400,000.00	2,475,168.80	0.42%
XS1711581337	700,000.00	4,332,286.29	0.73%
XS1711581337	3,083,000.00	19,077,363.56	3.23%
XS1711581337	500,000.00	3,094,988.28	0.52%
XS1711581337	200,000.00	1,237,796.08	0.21%
XS1958649854	1,500,000.00	10,255,458.13	1.74%
XS2100270508	2,965,000.00	18,047,770.91	3.05%
XS2112797290	1,500,000.00	8,746,019.80	1.48%
XS2112797290	1,024,000.00	5,971,572.48	1.01%
DE0005933931 - DAX UCITS ETF	4,825.00	3,368,474.24	0.57%
DE0005933931 - DAX UCITS ETF	2,460.00	1,717,398.26	0.29%

DE0005933931 - DAX UCITS ETF	8,130.00	5,675,791.83	0.96%
DE0005933931 - DAX UCITS ETF	7,300.00	5,096,344.44	0.86%
US4642874402 - IEF UP	4,300.00	3,139,210.85	0.53%
US4642874402 - IEF UP	25,900.00	18,908,269.98	3.20%
US4642874402 - IEF UP	4,370.00	3,190,314.28	0.54%
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF	2,030.00	3,434,406.91	0.58%
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF	2,835.00	4,796,326.90	0.81%
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF	219	370,509.91	0.06%
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF	3,590.00	6,073,655.58	1.03%
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF	1,075.00	1,818,713.02	0.31%
TOPLAM :	25,089,034.00	213,269,770.15	36.08%
L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:			
ALTIN	65	21,053,659.09	3.56%
TOPLAM :	65	21,053,659.09	3.56%
M) KATILIM HESAPLARI:			
N) KATILMA BELGELERİ:			
IAG	110,000.00	150,986.11	0.03%
TOPLAM :	110,000.00	150,986.11	0.03%
O) VOB İŞLEMLERİ:			
F_XU0300420	-871	127.65	0.00%
TOPLAM :	-871	127.65	0.00%
P) OPSİYON İŞLEMLERİ:			
R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:			
TL	15,958,967.84	15,958,967.84	2.70%
TOPLAM :	15,958,967.84	15,958,967.84	2.70%
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:			
T) DİĞER:			
RRP TRT041126T11	10,509,320.55	10,509,320.55	1.78%
RRP TRT050624T19	16,514,646.58	16,514,646.58	2.79%
RRP TRT060825T15	3,503,106.85	3,503,106.85	0.59%
RRP TRT060825T15	20,017,934.25	20,017,934.25	3.39%
RRP TRT070727T13	4,503,994.52	4,503,994.52	0.76%
RRP TRT070727T13	6,005,326.03	6,005,326.03	1.02%
RRP TRT070727T13	9,508,432.88	9,508,432.88	1.61%
RRP TRT080328T15	15,513,758.90	15,513,758.90	2.62%
RRP TRT080328T15	15,513,822.60	15,513,822.60	2.62%
RRP TRT080720T19	2,001,791.78	2,001,791.78	0.34%
RRP TRT111120T18	14,012,427.40	14,012,427.40	2.37%
RRP TRT140623T19	5,504,882.19	5,504,882.19	0.93%
RRP TRT190521T17	14,512,871.23	14,512,871.23	2.46%
RRP TRT230222T13	12,010,701.37	12,010,701.37	2.03%
RRP TRT230222T13	18,016,126.03	18,016,126.03	3.05%
RRP TRT240227T17	10,008,893.15	10,008,893.15	1.69%
RRP TRT240227T17	20,017,819.18	20,017,819.18	3.39%
RRP TRT280628T18	10,008,893.15	10,008,893.15	1.69%
RRP TRT280628T18	4,504,013.01	4,504,013.01	0.76%
BPP	214,199.64	214,199.64	0.04%
TOPLAM :	212,402,961.29	212,402,961.29	35.94%
FON PORTFÖY DEĞERİ	287,353,317.55	591,053,318.40	
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:			
	Tutarı	%	
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	591,053,318.40	100.63%	
B. HAZİR DEĞERLER (+) :	15,530,697.08	2.64%	
C. ALACAKLAR (+) :	175,548.03	0.03%	
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	0	0.00%	
E. BORÇLAR (-) :	19,407,576.29	3.30%	
FON TOPLAM DEĞERİ:	587,351,987.22		
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER			
Açıklama	Tutarı		
37001Fon Yönetim Ücreti	835,365.83		
37002Denetim Ücreti	246.96		
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	531.34		
370032O/N RRP Tahvil Borsa Payı	40,303.20		
370033Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	28,463.40		
37004Aracılık Komisyonu	113,443.20		
37005Vergi, Resim ve Harçlar	150.5		
37006Saklama Giderleri	17,403.28		
37008Banka Masrafları	652.91		
370142BİST Endeks K. Öltüçü Kullanım bedeli	621.19		

37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	129.87			
37023VOB İşlemi Komisyonu	29,517.68			
37024KM İşlemi Komisyonları	6,599.79			
37025Döviz Alım Kambiyo Vergisi	318,121.09			
37033KAP Ücreti	285.32			
37045Fon Saklama Ücreti	43,930.21			
37056Vergi Beyannameleri Smm Ödemesi	374.64			
37098Küsürat farkları	5.86			
37099Diğer Giderler	44.25			
TOPLAM	1,436,190.52			
6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI. TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR				
Açıklama	Nominal Değeri			
7- İTFALAR				
Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal Değeri		
TRFALNF22017	04/02/2020	500,000.00		
TRFALNF22017	04/02/2020	500,000.00		
TRFYKYM22012	19/02/2020	3,000,000.00		
8- ÖDÜNC İŞLEMLERİ:	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal Değeri	Tutar
Verilen Ödünçler				
TOPLAM :			34,570.00	3,978,104.15
TOPLAM :			0	0
TOPLAM :			0	0