

Mayıs 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:	584,718,300.35			
F. DOLAŞIMDAKİ PAY:	25,825,261,753.04			
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	21/08/2006			
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ			
2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER				
A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	0.022641			
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	0.022657			
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	-0.07%			
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	8.52%			
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	23.29%			
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ				
MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:				
Hisse Senedi	0.71%			
Varant				
Devlet Tahvili	2.69%			
Özel Sektör Tahvili	0.11%			
Finansman Bonosu	3.15%			
Banka Bonosu	2.54%			
Hazine Bonosu				
Devlet Tahvili Repo	42.07%			
Kuponlar Repo				
Hazine Bonosu Repo				
Varlığa Dayalı Menkuller				
Kira Sertifikaları	0.08%			
Katılım Hesabı				
Katılma Belgesi	0.03%			
GES				
GOS				
Borsa Para Piyasası	0.36%			
Kıymetli Madenler	11.57%			
VOB İşlemleri				
VOB Nakit Teminat İşlemleri	3.91%			
Yabancı Sabit Getiriliiler				
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	15.95%			
Opsiyon				
Swap				
Yabancı Hisse Senetleri	9.49%			
Vadeli Mevduat TL	7.34%			
Vadeli Mevduat Döviz				
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	23.89%			
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:				
Hisse Senedi	189.86%			
Devlet Borçlanma Senetleri	152.47%			
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	228.244			
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:	161,800,902.01			
T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN				
KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	29,911,346.27			
3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:				
	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%	
A) HİSSE SENETLERİ				
ALKIM	0.94	10.99	0.00%	
GLDTR	160,809.00	5,457,857.46	0.96%	
YKBNK	0.42	0.97	0.00%	
TOPLAM :	160,810.36	5,457,869.41	0.96%	
B) VARANTLAR:				
C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:				

TRT071020T23	5,000,000.00	4,876,067.50	0.86%
TRT160920T25	8,280,000.00	8,107,025.83	1.43%
TRT240724T15	1,000,000.00	952,290.60	0.17%
TOPLAM :	14,280,000.00	13,935,383.93	2.45%
D) BANKA BONOLARI:			
TRFAKBK72050	20,000,000.00	19,858,552.00	3.50%
TRFDZBKE2014	20,000,000.00	19,371,868.00	3.41%
TRFYKBK82067	25,000,000.00	24,576,515.00	4.33%
TOPLAM :	65,000,000.00	63,806,935.00	11.24%
E) FİNANSMAN BONOLARI:			
TRFAKYM72017	10,000,000.00	9,932,649.00	1.75%
TRFFIBA72039	20,000,000.00	19,826,506.00	3.49%
TRFFNBK82052	30,000,000.00	29,397,816.00	5.18%
TRFGRAN72066	30,000,000.00	29,593,329.00	5.21%
TOPLAM :	90,000,000.00	88,750,300.00	15.63%
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	265,667.12	0.05%
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	302,334.84	0.05%
TOPLAM :	560,000.00	568,001.96	0.10%
G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:			
H) GELİRE ENDEKSİ SENETLER:			
I) KİRA SERTİFİKALARI:			
TRDHVKA62043	200,000.00	206,194.00	0.04%
TRDZKVK62010	40,000.00	41,001.72	0.01%
TOPLAM :	240,000.00	247,195.72	0.04%
J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:			
K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:			
XS1508914691	2,000,000.00	13,767,691.73	2.42%
XS1605397394	3,900,000.00	26,301,704.08	4.63%
XS1613091500	1,000,000.00	6,763,446.02	1.19%
XS1711581337	4,883,000.00	32,362,467.50	5.70%
XS1760780731	600,000.00	4,070,005.39	0.72%
XS2100270508	965,000.00	6,344,852.14	1.12%
XS2112797290	24,000.00	152,461.77	0.03%
US4642874402 - IEF UP	41,300.00	34,315,128.08	6.04%
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF	2,030.00	3,869,505.92	0.68%
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF	1,879.00	3,581,675.67	0.63%
US9229083632 - VANGUARD S&P 500 ETF	3,590.00	6,843,116.37	1.21%
TOPLAM :	13,420,799.00	138,372,054.68	24.37%
L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:			
ALTIN	145	54,491,831.72	9.60%
TOPLAM :	145	54,491,831.72	9.60%
M) KATILIM HESAPLARI:			
N) KATILMA BELGELERİ:			
IAG	110,000.00	155,809.17	0.03%
TOPLAM :	110,000.00	155,809.17	0.03%
O) VOB İŞLEMLERİ:			
P) OPSİYON İŞLEMLERİ:			
R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:			
TL	20,111,808.77	20,111,808.77	3.54%
TOPLAM :	20,111,808.77	20,111,808.77	3.54%
S) DÖVİZE ENDEKSİ TAHVİLLER:			
T) DİĞER:			
VL Vadeli Mevduat TL	9,186,859.45	9,144,991.98	1.61%
VL Vadeli Mevduat TL	9,172,452.03	9,140,568.47	1.61%

VL Vadeli Mevduat TL		10,217,314.87	10,157,522.79	1.79%	
VL Vadeli Mevduat TL		10,217,314.87	10,157,522.79	1.79%	
RRP TRT020322T17		19,013,476.99	19,013,476.99	3.35%	
RRP TRT020823T11		3,002,132.88	3,002,132.88	0.53%	
RRP TRT020823T11		5,003,554.79	5,003,554.79	0.88%	
RRP TRT020823T11		15,010,664.38	15,010,664.38	2.64%	
RRP TRT050624T35		1,000,709.32	1,000,709.32	0.18%	
RRP TRT050624T35		1,000,709.32	1,000,709.32	0.18%	
RRP TRT060121T16		12,008,304.66	12,008,304.66	2.11%	
RRP TRT080323T10		15,010,676.71	15,010,676.71	2.64%	
RRP TRT080323T10		5,003,558.90	5,003,558.90	0.88%	
RRP TRT080328T15		16,011,388.49	16,011,388.49	2.82%	
RRP TRT080720T19		6,504,498.36	6,504,498.36	1.15%	
RRP TRT120820T12		5,503,806.30	5,503,806.30	0.97%	
RRP TRT160920T25		14,510,034.79	14,510,034.79	2.56%	
RRP TRT170822T15		19,013,476.99	19,013,476.99	3.35%	
RRP TRT210721T11		4,002,847.12	4,002,847.12	0.70%	
RRP TRT280628T18		1,501,041.78	1,501,041.78	0.26%	
BPP		258,182.37	258,182.37	0.05%	
TOPLAM :		182,153,005.37	181,959,670.18	32.04%	
FON PORTFÖY DEĞERİ		386,036,568.50	567,856,860.54		
4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:					
	Tutarı		%		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:		567,856,860.54	97.12%		
B. HAZİR DEĞERLER (+) :		20,308,191.34	3.47%		
C. ALACAKLAR (+) :		0	0.00%		
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :		0	0.00%		
E. BORÇLAR (-) :		3,446,751.53	0.59%		
FON TOPLAM DEĞERİ:		584,718,300.35			
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER					
Açıklama	Tutarı				
37001Fon Yönetim Ücreti		846,787.31			
37002Denetim Ücreti		246.96			
3700320/N RRP Tahvil Borsa Payı		22,008.00			
370033Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı		29,349.60			
37004Aracılık Komisyonu		2,738.10			
37005Vergi, Resim ve Harçlar		150.5			
37006Saklama Giderleri		26,304.77			
37008Banka Masrafları		2,324.69			
370142BİST Endeks K. Öltücü Kullanım bedeli		2,555.16			
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu		614.9			
37021Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti		8,553.75			
37023VOB İşlemi Komisyonu		6,115.20			
37024KM İşlemi Komisyonları		9,775.12			
37025Döviz Alım Kambiyo Vergisi		20,394.00			
37033KAP Ücreti		285.32			
37045Fon Saklama Ücreti		44,494.74			
37056Vergi Beyannameleri Smm Ödemesi		374.64			
37098Küsürat farkları		0.15			
TOPLAM		1,023,072.91			
6-GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI.BEDELİSİZ HİSSE SENEDİ ALIM. TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR					
Açıklama	Nominal Değeri				
ALKIM Bds:%507		19,000.00			
7- İTFALAR					
Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi		Nominal Değeri		
TRDZKV52011	06/05/2020		1,050,000.00		
TOPLAM :				0	0
TOPLAM :				0	0