

HSBC Portföy Orta Vadeli Borçlanma Araçları Fonu

**1 Ocak - 31 Aralık 2020 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 2020 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

28 Nisan 2021
İstanbul, Türkiye

HSBC Portföy Orta Vadeli Borçlanma Araçları Fonu

31 Aralık 2020 tarihli toplam değer/net varlık değeri tablosu (Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

HST - HSBC PORTFÖY ORTA VAD. BORÇLANMA ARAÇ. FONU 31 Aralık 2020 TARİHLİ GÜNLÜK RAPORUDUR

MENKUL KIYMET	DÖVİZ CİNSİ	İHRAÇCI KURUM	VADE TARİHİ	VADEYE KALAN GÜN	NOMİNAL FAİZ ORANI	FAİZ ÖDEME SAYISI	NOMİNAL DEĞER	BİRİM ALIŞ FİYATI	SATIN ALIŞ TARİHİ	İÇ İSKONTO ORANI (%)	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																		
TRT201021T25	TL	HAZİNE	20/10/21		0,00		500.000,00	105,852700	28/08/20	16,292377		732350893869790198		101,459682	507.298,41	4,86	4,69	4,83
TRT040522T13	TL	HAZİNE	04/05/22		0,00		500.000,00	99,370900	21/05/20	15,357358		728391552498445661		94,720186	473.600,93	4,54	4,38	4,51
TRT170822T15	TL	HAZİNE	17/08/22		0,00		500.000,00	103,674200	21/08/20	15,158939		731954245049896827		98,590371	492.951,86	4,72	4,56	4,70
TRT091122T10	TL	HAZİNE	09/11/22		0,00		500.000,00	100,912900	18/12/20	15,003296		736784399631140743		101,163858	505.819,29	4,85	4,68	4,82
TRT180123T10	TL	HAZİNE	18/01/23		0,00		500.000,00	104,382500	17/12/20	14,422297		734210992666286847		102,614400	513.072,00	4,92	4,75	4,89
TRT080323T10	TL	HAZİNE	08/03/23		0,00		600.000,00	92,534500	21/05/20	14,373707		728391552498446330		89,919251	539.515,51	5,15	4,99	5,14
TRT270923T11	TL	HAZİNE	27/09/23		0,00		550.954,00	89,984000	19/10/20	14,236678		734408080125018972		91,357164	503.335,95	4,82	4,66	4,80
TRT240724T15	TL	HAZİNE	24/07/24		0,00		535.214,00	90,552500	12/10/20	13,494452		734013355451917891		92,710518	496.199,67	4,75	4,59	4,73
TRT120325T12	TL	HAZİNE	12/03/25		0,00		100.000,00	84,196700	03/09/20	13,365786		731993552591056872		86,849323	86.849,32	0,83	0,80	0,83
TRT011025T16	TL	HAZİNE	01/10/25		0,00		500.000,00	101,457700	17/12/20	13,201613		736743992578638250		102,487182	512.435,91	4,91	4,74	4,88
TRT110226T13	TL	HAZİNE	11/02/26		0,00		500.000,00	93,177500	25/09/20	12,845105		733419069416443930		97,234677	486.173,38	4,66	4,50	4,63
TRT240227T17	TL	HAZİNE	24/02/27		0,00		274,00	99,959900	04/03/20	13,003484		725305773114177497		97,113025	266,09	0,00	0,00	0,00
TRT110827T16	TL	HAZİNE	11/08/27		0,00		500.000,00	98,068900	06/08/20	12,897311		728391552498458567		95,241533	476.207,66	4,56	4,41	4,54
GRUP TOPLAMI							5.786.442,00						5.593.725,98	53,57	51,75	53,30		
Özel Sektör																		
Finansman Bonosu																		
TRFHSBC52115	TL	HSBC BANK A.Ş.	05/05/21		15,00		170.000,00	92,055000	07/10/20	19,423927				94,285236	160.284,90	1,54	1,48	1,53
GRUP TOPLAMI							170.000,00						160.284,90	1,54	1,48	1,53		
Özel Sektör Tahvil																		
TRSBOLU12115	TL	BOLU ÇİMENTO SANAYİİ A.Ş.	11/01/21		21,17		200.000,00	100,000000	18/10/19	16,697540				103,573723	207.147,45	1,98	1,92	1,97
TRSTPRS12115	TL	TÜPRAŞ-TÜRKİYE PETROL RAFİNERİLERİ A.Ş.	22/01/21		26,45		300.000,00	100,000000	18/10/19	20,789948				102,746469	308.239,41	2,95	2,85	2,94
TRSIGY12113	TL	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.	25/01/21		26,74		40.000,00	100,000000	18/10/19	16,981468				103,097242	41.238,90	0,40	0,38	0,39
TRSTPRS22114	TL	TÜPRAŞ-TÜRKİYE PETROL RAFİNERİLERİ A.Ş.	05/02/21		22,82		200.000,00	100,000000	18/10/19	18,654137				102,674835	205.349,67	1,97	1,90	1,96
TRSOPAS22129	TL	OPET PETROL CÜLÜK A.Ş.	19/02/21		21,46		200.000,00	100,000000	18/10/19	18,786488				102,043025	204.086,05	1,96	1,89	1,95

HSBC Portföy
Orta Vadeli Borçlanma Araçları Fonu
31 Aralık 2020 tarihli toplam değer/net varlık değeri tablosu
(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

TRSMGTI22115	TL	MİGROS TİCARET A.Ş.	24/02/21	23,04	200.000,00	100,000000	18/10/19	19,534416		102,345849	204.691,70	1,96	1,89	1,95	
TRSOTKO32110	TL	OTOKOÇ OTOMOTIV TIC VE SAN A.Ş.	15/03/21	40,19	150.000,00	100,000000	18/10/19	16,203585		101,320891	151.981,34	1,46	1,41	1,45	
TRSIGY32111	TL	İŞ GAYRİMENKUL YATIRIM ORTAKLIĞI A.Ş.	23/03/21	17,51	220.000,00	100,000000	18/10/19	16,752644		100,614027	221.350,86	2,12	2,05	2,11	
TRSVSTL72110	TL	VESTEL ELEKTRONİK A.Ş	16/07/21	4,00	500.000,00	100,000000	09/07/20	13,936710		103,662662	518.313,31	4,97	4,80	4,94	
TRSDZBK12218	TL	DENİZBANK A.Ş.	21/01/22	10,75	500.000,00	85,690000	03/07/20	10,453614		90,117461	450.587,31	4,32	4,17	4,29	
TRSTISB22212	TL	T.İŞ BANKASI A.S.	07/02/22	10,00	200.000,00	100,000000	10/02/20	16,883364		102,305540	204.611,08	1,96	1,89	1,95	
TRSMGTI62210	TL	MİGROS TİCARET A.Ş.	08/06/22	7,00	200.000,00	100,000000	10/06/20	20,096543		100,510983	201.021,97	1,93	1,86	1,92	
TRSMGTI62228	TL	MİGROS TİCARET A.Ş.	08/06/22	10,12	200.000,00	100,000000	10/06/20	15,326524		101,026750	202.053,50	1,94	1,87	1,93	
TRSENSA32314	TL	ENERJISA ENERJİ A.Ş.	30/03/23	5,07	200.000,00	100,000000	18/10/19	3,551798		154,147808	308.295,62	2,95	2,85	2,94	
TRSAEST91812	TL	AE ARMA ELEKTROPANÇ ELEKTROMEKANİK	28/09/23	1,65	300.000,00	100,000000	18/10/19	0,000000		100,000000	300.000,00	2,87	2,78	2,86	
TRSTISB72712	TL	T.İŞ BANKASI A.S.	27/07/27	19,27	400.000,00	100,000000	18/10/19	18,275833		103,214392	412.857,57	3,96	3,82	3,93	
TRSVKFB92719	TL	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	06/09/27	18,56	210.000,00	100,195000	18/10/19	15,933599		107,459423	225.664,79	2,16	2,09	2,15	
TRSGRAN23013	TL	GARANTİ BANKASI	14/02/30	8,00	300.000,00	100,000000	28/09/20	18,728099		105,286348	315.859,04	3,03	2,92	3,01	
GRUP TOPLAMI					4.520.000,00					4.683.349,57		44,89	43,34	44,64	
GRUP TOPLAMI					4.690.000,00					4.843.634,47		46,43	44,82	46,17	
GRUP TOPLAMI					10.476.442,00					10.437.360,45		100,00	96,57	99,47	
TPP															
TPP			04/01/21	17,85	370.723,78	17,850000	31/12/20		220880	370.723,78	17,970000	370.723,78	100,00	3,43	3,53
GRUP TOPLAMI					370.723,78					370.723,78		100,00	3,43	3,53	
GRUP TOPLAMI					370.723,78					370.723,78		100,00	3,43	3,53	
FON PORTFÖY DEĞERİ										10.808.084,23			100,00		

HSBC Portföy
Orta Vadeli Borçlanma Araçları Fonu

31 Aralık 2020 tarihli toplam değer/net varlık değeri tablosu
(Tüm tutarlar, Türk Lirası ("TL") olarak gösterilmiştir.)

31 Aralık 2020			
	Tutar	Grup	Toplam
	TL	%	%
FON PORTFÖY DEĞERİ	10.808.084		103,01%
HAZIR DEĞERLER	14.904		0,14%
Kasa	-	0%	0%
Bankalar	14.904	100%	0,14%
Diğer Hızır Değerler	-	0%	0%
ALACAKLAR	-		0%
Takastan Alacaklar Toplamı	-	0%	0%
Diğer Alacaklar	-		0%
BORÇLAR	-330.535		-3,15%
Takasa Borçlar	-	0%	0%
Yönetim Ücreti	-21.792	6,59%	-0,21%
Ödenecek Vergi	-	0%	0%
İhtiyatlar	-	0%	0%
DİĞER_BORÇLAR	-308.218	93,41%	-2,94%
Kayda Alma Ücreti	-525	0,16%	0%
Krediler	-	0%	0%
Fon toplam değeri	10.492.454	100%	100%