

Nisan 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:	936,549,814.45			
F. DOLAŞIMDAKİ PAY:	34,639,751,013.04			
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	21/08/2006			
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ			
2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER				
A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	0.027037			
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	0.026588			
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	1.69%			
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	6.19%			
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	19.33%			
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:				
Hisse Senedi	5.00%			
Varant				
Devlet Tahvili	4.15%			
Özel Sektör Tahvili	0.00%			
Finansman Bonosu	4.83%			
Banka Bonosu				
Hazine Bonosu				
Devlet Tahvili Repo	46.32%			
Kuponlar Repo				
Hazine Bonosu Repo				
Varlığa Dayalı Menkuller				
Kira Sertifikaları	0.01%			
Katılım Hesabı				
Katılma Belgesi	0.02%			
GES				
GOS				
Borsa Para Piyasası	1.44%			
Kıymetli Madenler	2.97%			
VOB İşlemleri				
VOB Nakit Teminat İşlemleri	4.32%			
Yabancı Sabit Getiriliiler				
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	7.32%			
Opsiyon				
Swap				

Yabancı Hisse Senetleri	20.66%			
Vadeli Mevduat TL	2.96%			
Vadeli Mevduat Döviz				
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	0.35			
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:				
Hisse Senedi	0.44			
Devlet Borçlanma Senetleri	0.54			
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	316.43			
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:	35,013,450.32			
T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN				
KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	69,164,821.12			
3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:				

Menkul	İhraççı	ISIN	Vade	Nominal	Nominal	Birim	Repo	Günlük	Günlük	Toplam
Kıymet	Kurum	KODU	Tarihi	Faiz	Deger/	Alış	Teminat	Birim	Kur	Deger
				Oranı	Kontrat Sayısı	Fiyatı	Tutar	Deger		
A. HİSSE SENETLERİ										
AKSEN	AKSA ENERJİ ÜRETİM ANONİM ŞİRK	TREAKSN00011			470,000.00	10.63		11.44		5,376,800.00
ALKIM	Alkim Alkali Kimya A.Ş.	TRAALKIM91E0			0.94	7.31		17.22		16.19
CCOLA	COCA-COLA ICECEK A.Ş	TRECOLA00011			54,500.00	73.79		78.85		4,297,325.00
DOHOL	Doğan Şirketler Grubu Holding	TRADOHOL91Q8			1,500,000.00	3.29		2.95		4,425,000.00
ISMEN	İş Yatırım Menkul Değerler A.Ş	TREISMD00011			500,000.00	9.63		15.36		7,680,000.00
KRDMD	Kardemir (D) Karabük Demir Çel	TRAKRDMR91G7			750,000.00	4.90		7.16		5,370,000.00
PETKM	Petkim Petrokimya Holding A.Ş	TRAPETKM91E0			400,000.00	6.08		6.71		2,684,000.00
TAVHL	TAV Havalimanları Holding A.Ş	TRETAVH00018			8,185.00	21.62		21.52		176,141.20
TAVHL	TAV Havalimanları Holding A.Ş	TRETAVH00018			13,642.00	21.66		21.52		293,575.84
TAVHL	TAV Havalimanları Holding A.Ş	TRETAVH00018			13,710.00	21.64		21.52		295,039.20
TAVHL	TAV Havalimanları Holding A.Ş	TRETAVH00018			25,214.00	21.68		21.52		542,605.28
TAVHL	TAV Havalimanları Holding A.Ş	TRETAVH00018			59,249.00	21.70		21.52		1,275,038.48
					120,000.00					2,582,400.00
VESBE	Vestel Beyaz Eşya San.Tic. A.	TREVEST00017			50,000.00	48.80		53.75		2,687,500.00
YATAS	Yataş Yatak Yorgan Sanayi Ti	TRAYATAS91B4			583,476.00	12.97		16.87		9,843,240.12
YKBNK	Yapı ve Kredi Bankası A.Ş.	TRAYKBNK91N6			0.42	2.98		2.10		0.87
GRUP TOPLAMI										
B.BORÇLANMA DEVLET TAHVİLİ										
TRT220921T18	Hazine / Turkish Treasury	TRT220921T18	22/09/2021	0.046	610,000.00	97.53		97.94		597,452.12

TRT210623T10	Hazine / Turkish Treasury	TRT210623T10	21/06/2023	0.025	500,000.00	100.77		101.49		507,425.55
TRT131130T14	Hazine / Turkish Treasury	TRT131130T14	13/11/2030	0.117	45,000,000.00	97.69		77.57		34,907,787.00
EURO TAHVİL (TÜRK)										
US900123BZ27	Hazine / Turkish Treasury	US900123BZ27	26/09/2022	0.0625	- 650,000.00	103.88		104.52	8.23	- 5,591,937.71
US900123BZ27	Hazine / Turkish Treasury	US900123BZ27	26/09/2022	0.0625	5,500,000.00	103.75		103.86	8.23	47,017,607.11
US900123BZ27	Hazine / Turkish Treasury	US900123BZ27			4,850,000.00					41,425,669.40
XS1711581337	Fibabanka A.Ş.	XS1711581337	25/01/2023	0.03	4,883,000.00	101.48		102.51	8.23	41,201,292.08
XS1760780731	Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O.	XS1760780731	30/01/2023	0.0288	600,000.00	97.68		102.94	8.23	5,083,856.60
XS2100270508	TÜRKİYE SİNÂİ KALKINMA BANKASI A.Ş.	XS2100270508	23/01/2025	0.03	965,000.00	102.59		101.72	8.23	8,079,949.02
XS2112797290	TÜRKİYE VAKIFLAR BANKASI T.A.O.	XS2112797290	05/02/2025	0.0263	24,000.00	98.78		99.21	8.23	195,983.81
					57,432,000.00					131,999,415.57
ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ										
TRFDGOZ71915	DÜNYA GÖZ HASTANESİ	TRFDGOZ71915	26/12/2030	0.2383	17,760.00	101.66		101.66	1.00	18,054.64
TRFDGOZ71915	DÜNYA GÖZ HASTANESİ	TRFDGOZ71915	26/12/2030	0.2383	- 17,760.00	101.66		101.66	1.00	- 18,054.64
TRFDGOZ71915					-					-
TRSAKYP41612	Akyürek Tüketim Ürünleri Paz.	TRSAKYP41612	26/12/2030	0.0297	342,500.00	101.36		101.36	1.00	347,145.57
TRSAKYP41612	Akyürek Tüketim Ürünleri Paz.	TRSAKYP41612	26/12/2030	0.0297	- 342,500.00	101.36		101.36	1.00	- 347,145.57
TRSAKYP41612					-					-
TRSAYNS21711	Aynes Gıda	TRSAYNS21711	22/02/2030	0.0304	- 400,000.00	103.04		103.04	1.00	- 412,169.64
TRSAYNS21711	Aynes Gıda	TRSAYNS21711	22/02/2030	0.0304	400,000.00	103.04		103.04	1.00	412,169.64
TRSAYNS21711					-					-
TRSAYNSK1619	Aynes Gıda	TRSAYNSK1619	16/11/2030	0.0332	70,000.00	100.27		103.10	1.00	72,167.65
TRSAYNSK1619	Aynes Gıda	TRSAYNSK1619	16/11/2030	0.0332	80,000.00	103.10		103.10	1.00	82,477.32
TRSAYNSK1619	Aynes Gıda	TRSAYNSK1619	16/11/2030	0.0332	- 70,000.00	100.27		103.10	1.00	- 72,167.65
TRSAYNSK1619	Aynes Gıda	TRSAYNSK1619	16/11/2030	0.0332	- 80,000.00	103.10		103.10	1.00	- 82,477.32
TRSAYNSK1619					-					-
					-					-
FİNANSMAN BONOSU										
TRFFINF82115	Qnb Finans Faktoring A.Ş.	TRFFINF82115	04/08/2021	0	19,000,000.00	94.44		95.36		18,117,944.00
TRFH5BC52115	Hsbc Bank A.Ş.	TRFH5BC52115	05/05/2021	0	20,110,000.00	92.06		99.92		20,093,200.11
TRFVFAS72119	Vakıf Faktoring	TRFVFAS72119	01/07/2021	0	5,880,000.00	95.41		96.97		5,701,720.75
GRUP TOPLAMI					102,422,000.00					175,912,280.43
C. KATILMA										
BELGESİ										
YERLİ KATILMA BELGESİ		IAG			110,000.00	1.34		1.70		187,131.23
GRUP TOPLAMI					110,000.00					187,131.23
D. OPSİYON										
İŞLEMLER										
E.YABANCI SENETLERİ										
CPER US EQUİTY	United States Copper Index Fund	US9117181043		0.00%	83,400.00	25.64		27.63	8.23	18,967,269.44
CPER US EQUİTY	United States Copper Index Fund	US9117181043		0.00%	93,186.00	22.24		27.63	8.23	21,192,853.35
		US9117181043			176,586.00					40,160,122.79
EWG US EQUITY	iShares MSCI Germany ETF	US4642868065		0.00%	130,920.00	34.56		34.94	8.23	37,646,501.41
SPY US EQUITY	SPDR S&P 500 ETF	US78462F1030		0.00%	8,670.00	382.36		418.35	8.23	29,854,977.54
SPY US EQUITY	SPDR S&P 500 ETF	US78462F1030		0.00%	2,250.00	382.99		418.35	8.23	7,747,831.54
SPY US EQUITY	SPDR S&P 500 ETF	US78462F1030		0.00%	2,950.00	406.40		418.35	8.23	10,158,268.02

[illegible]

YKBNK Tem:%6	0.42			
TIP US EQUITY Tem:%14	56,190.00			
ALKIM Tem:%52	0.94			
DOHOL Tem:%7	1,500,000.00			
B-GEÇEN AY İÇİNDE YATIRIM FONLARINA İLİŞKİN MEVZUATTA MEYDANA GELEN DEĞİŞME VE HUKUKİ İHTİLAFLARLA İLGİLİ				
Açıklamalar				
7- İTFALAR				
Menkul Kıymet Türü	İtfa Tarihi	Nominal Değeri		
TRFISFA42119	08/04/2021	15,000,000.00		
TRFYTFM42119	13/04/2021	3,000,000.00		
TRT140421T13	14/04/2021	1,530,000.00		
TRDZKVK42111	14/04/2021	180,000.00		
TRT210421T14	21/04/2021	100,000.00		
TRFTEBK42130	22/04/2021	3,000,000.00		
TOPLAM :			5,236.00	64,097,197.00
Yabancı Hisse	US78462F1030 - SPDR S&P 500 ETF	05/04/2021	2,950.00	1,198,876.00
TOPLAM :			154,320.00	8,166,017.24
8- ÖDÜNC İŞLEMLERİ:	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal Değeri	Tutar
Verilen Ödünçler				
TOPLAM :			-	0.00%
Alınan Ödünçler				
TOPLAM :			-	0.00%