

Ekim 2021 Portföy Dağılım Raporu

1- FONU TANITICI BİLGİLER				
A. FONUN ADI:	QNB Finans Portföy Eurobond Borçlanma Araçları Fonu			
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	QNB FINANS PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.			
C. YÖNETİCİ ÜNVANI:	QNB FINANS PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.			
D. FON TUTARI	0			
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	166,571,963.76			
F. DOLAŞIMDAKİ PAY:	1,483,654,808.00			
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	23/09/2004			
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ			
2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER				
A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	0.112271			
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	0.10609			
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	5.83%			
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	24.60%			
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	24.40%			
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ				
MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:				
Hisse Senedi				
Varant				
Devlet Tahvili				
Özel Sektör Tahvili				
Finansman Bonosu				
Banka Bonosu				
Hazine Bonosu				
Devlet Tahvili Repo	13.11%			
Kuponlar Repo				
Hazine Bonosu Repo	0.35%			
Varlığa Dayalı Menkuller				
Kira Sertifikaları				
Katılım Hesabı				
Katılma Belgesi				
GES				
GOS				
Borsa Para Piyasası	0.25%			
Kıymetli Madenler				
VOB İşlemleri				
VOB Nakit Teminat İşlemleri	0.17%			
Yabancı Sabit Getiriliiler				
Euro Bond (Euro Tahvil Türk)	86.12%			
Opsiyon				
Swap				
Yabancı Hisse Senetleri				
Vadeli Mevduat TL				
Vadeli Mevduat Döviz				
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	13.65%			
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:				
Hisse Senedi	0.00%			
Devlet Borçlanma Senetleri	40.24%			
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	1,291.61			
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:		39,829,252.04											
T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN													
KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:		7,948,906.21											
3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:													
Menkul Kıymet	İhraççı Kurum	Vade Tarihi	ISIN Kodu	Nominal Faiz Oranı	Nominal	Birim Alış Fiyatı	Satın Alış Tarihi	İç İskonto Oranı	Repo	Günlük Birim Deger	Günlük Kur	Toplam Deger	
A.HİSSE SENEDİ													
B.BORÇLANMA SENETLERİ													
XS1788516679	Yapı ve Kredi Bankası	16/03/2023	XS1788516679	3.05%	400,000.00	106.01778	24/06/2021			103.88	9.4813	3,939,669.78	
US900123CA66	Türk Hazinesi	23/03/2023	US900123CA66	3.25%	1,560,000.00	101.07542	09/07/2021			99.76	9.4813	14,755,330.01	
US900123CF53	Türk Hazinesi	22/03/2024	US900123CF53	2.88%	1,200,000.00	102.88055	14/10/2021			102.696	9.4813	11,684,299.02	
XS1578203462	İş Bankası	25/04/2024	XS1578203462	3.06%	1,445,000.00	106.0396	07/10/2021			102.746	9.4813	14,076,693.64	
US900123CV04	Türk Hazinesi	10/08/2024	US900123CV04	6.35%	500,000.00	103.50819	27/10/2021			104.634	9.4813	4,960,331.72	
US900123CW86	Türk Hazinesi	14/11/2024	US900123CW86	5.60%	300,000.00	103.23139	13/07/2020			103.609	9.4813	2,947,044.04	
XS2100270508	Türkiye Sınai Kalkınma Bankası	23/01/2025	XS2100270508	3.00%	150,000.00	102.47185	25/02/2020			102.182	9.4813	1,453,227.29	
US900123AW05	Türk Hazinesi	05/02/2025	US900123AW05	7.38%	2,774,000.00	109.59509	10/09/2021			107.56	9.4813	28,289,491.34	
XS1210422074	Akbank	31/03/2025	XS1210422074	2.56%	500,000.00	101.44556	14/01/2020			99.901	9.4813	4,735,956.76	
XS2274089288	T.C. Ziraat Bankası	02/03/2026	XS2274089288	2.69%	200,000.00	101.54271	29/07/2021			97.39	9.4813	1,846,767.61	
XS2332876106	Turk Eximbank	06/07/2026	XS2332876106	2.88%	600,000.00	99.77361	14/07/2021			99.515	9.4813	5,661,189.42	
US900123CL22	Türk Hazinesi	25/03/2027	US900123CL22	3.00%	1,200,000.00	99.97222	21/07/2020			99.746	9.4813	11,348,661.00	
US900123CQ19	Türk Hazinesi	24/10/2028	US900123CQ19	6.13%	1,300,000.00	101.36698	06/07/2020			98.584	9.4813	12,151,158.23	
US900123CT57	Türk Hazinesi	26/04/2029	US900123CT57	7.63%	500,000.00	112.56839	21/10/2020			105.781	9.4813	5,014,706.98	
US900123AL40	Türk Hazinesi	15/01/2030	US900123AL40	5.94%	330,000.00	170.96107	25/06/2021			136.282	9.4813	4,264,030.74	
US900123AT75	Türk Hazinesi	14/02/2034	US900123AT75	4.00%	160,000.00	127.03559	22/01/2020			109.522	9.4813	1,661,457.50	
US900123AY60	Türk Hazinesi	17/03/2036	US900123AY60	3.44%	200,000.00	116.20587	04/02/2016			98.051	9.4813	1,859,301.89	
US900123BG46	Türk Hazinesi	30/05/2040	US900123BG46	6.75%	150,000.00	120.67692	19/08/2016			96.982	9.4813	1,379,273.15	
US900123BJ84	Türk Hazinesi	14/01/2041	US900123BJ84	3.00%	90,000.00	108.93333	28/10/2015			88.596	9.4813	756,004.73	
					13,559,000.00							132,784,594.85	
C. KATILMA BELGESİ													
D. OPSİYON İŞLEMLER													
E.YABANCI HİSSE													
F.TERS REPO													
TRT190826T19		01/11/2021	TRT190826T19	16.45%	1,001,802.74	96.797	28/10/2021	0.00%	1,033,085.00	96.971957		1,001,802.74	
TRT140126T11		01/11/2021	TRT140126T11	16.55%	26,047,156.16	206.233	28/10/2021	0.00%	12,607,105.00	206.606958		26,047,156.16	
					27,048,958.90				13,640,190.00			27,048,958.90	
G.KATILIM HESABI													
H.VADELİ MEVDUAT													
I.KIYMETLİ MADEN													
J.YABANCI TAHVİL													
K.BORSA PARA PİYASASI													
		01/11/2021		12.55%	390,536.38	100,000.00	28/10/2021	0.00%		100,137.53		390,536.38	
					390,536.38							390,536.38	

[illegible]

TOPLAM :			0	0