Mayıs 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:	1,011,799,365.30			
F. DOLAŞIMDAKİ PAY:	36,536,341,710.04			
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	21/08/2006			
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ			
2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER				
A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	0.027693			
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	0.027037			
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	2.43%			
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	8.77%			
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	22.24%			
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ				
MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:				
Hisse Senedi	5.71%			
Varant				
Devlet Tahvili	4.00%			
Özel Sektör Tahvili	0.00%			
Finansman Bonosu	0.0291			
Banka Bonosu				
Hazine Bonosu				
Devlet Tahvili Repo	43.52%			
Kuponlar Repo				
Hazine Bonosu Repo				
Varlığa Dayalı Menkuller				
Kira Sertifikaları	0.00%			
Katılım Hesabı				
Katılma Belgesi	0.02%			
GES				
GOS				
Borsa Para Piyasası	4.52%			
Kıymetli Madenler	0.0337			
VOB İşlemleri				
VOB Nakit Teminat İşlemleri	0.0427			
Yabancı Sabit Getirililer				
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	0.11			
Opsiyon				
Swap				
Yabancı Hisse Senetleri	15.59%			
Vadeli Mevduat TL	1.19%			
Vadeli Mevduat Döviz	4.03%			
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	0.36			
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:				
Hisse Senedi	0.29			
Devlet Borçlanma Senetleri	0.01			
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	287.08			
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:	94,405,232.18			
T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN				
KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	42,030,714.78			
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												
AKSEN	AKSA ENERJİ ÜRETİM ANONİM ŞİRK		AKSEN		470000	10.631	26/02/2021			12.9		6063000

ALKIM	Alkim Alkali Kimya A.Ş.		ALKIM		0.94	7.31	23/01/2020			15.62		14.68
CCOLA	COCA-COLA ICECEK A.Ş		CCOLA		54500	73.792	09/03/2021			79.4		4327300
DOHOL	Doğan Şirketler Grubu Holding		DOHOL		1,500,000.00	3.29	06/04/2021			2.94		4,410,000.00
EREGL	Ereğli Demir Çelik		EREGL		200,000.00	20.31	11/05/2021			19.23		3,846,000.00
ISMEN	İş Yatırım Menkul Değerler A.Ş		ISMEN		500,000.00	9.625	16/02/2021			16.72		8,360,000.00
KLKIM	KALEKIM YAPI KİMYASALLARI		KLKIM		320,000.00	14.75	17/05/2021			12.77		4,086,400.00
KRDMD	Kardemir (D) Karabük Demir Çel		KRDMD		400,000.00	4.902	02/12/2020			7.86		3,144,000.00
PETKM	Petkim Petrokimya Holding A.Ş		PETKM		580,000.00	6.254	10/05/2021			6.18		3,584,400.00
TAVHL	TAV Havalimanları Holding A.Ş		TAVHL		160,000.00	22.323	10/05/2021			23.98		3,836,800.00
TUPRS	Tüpraş Türkiye Petrol Rafinele		TUPRS		20,000.00	102.65	24/05/2021			97.35		1,947,000.00
YATAS	Yataş Yatak Yorgan Sanayi Ti		YATAS		583,476.00	12.969	21/01/2021			15.78		9,207,251.28
YKBNK	Yapı ve Kredi Bankası A.Ş.		YKBNK		0.42	2.98	19/11/2020			2.15		0.89
GRUP TOPLAMI					4787977.36							52812166.86
B.BORÇLANMA SENETLERİ												
DEVLET TAHVİLİ												
TRT220921T18	Hazine / Turkish Treasury	22/09/2021	TRT220921T18	4.60%	610,000.00	97.528	28/04/2021	35.74%		99.34233		605,988.21
TRT170822T15	Hazine / Turkish Treasury	17/08/2022	TRT170822T15	5.35%	127,000.00	94.844	20/05/2021	12.80%		95.67226		121,503.77
TRT210623T10	Hazine / Turkish Treasury	21/06/2023	TRT210623T10	0.025	500,000.00	100.767	19/04/2021	0.0064		103.02955		515,147.75
TRT131130T14	Hazine / Turkish Treasury	13/11/2030	TRT131130T14	11.70%	45,000,000.00	97.688	09/02/2021	4.06%		72.66506		32,699,277.00
TRDZKVK72118	Ziraat Katılım Varlık Kiralama	06/07/2021	TRDZKVK72118	0.00%	10,000.00	102.3301	04/05/2021	-29.86%		103.45897		10,345.90
US900123BZ27	Hazine / Turkish Treasury	26/09/2022	US900123BZ27	0.0625	4,850,000.00	103.75422	28/04/2021			105.253	8.499	43,385,444.48
XS1711581337	Fibabanka A.Ş.	25/01/2023	XS1711581337	3.00%	4,883,000.00	101.47996	03/03/2020			102.868	8.499	42,690,854.70
XS1760780731	Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O.	30/01/2023	XS1760780731	2.88%	600,000.00	97.67708	15/05/2020			104.551	8.499	5,331,473.69
XS1970705528	Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O.	28/03/2024	XS1970705528	0.0406	200000	109.64444	02/06/2021			109.485	8.499	1861026.03
XS2100270508	TÜRKİYE SINAİ KALKINMA BANKASI A.Ş.	23/01/2025	XS2100270508	3.00%	965,000.00	102.58813	26/02/2020			103.111	8.499	8,456,684.75
XS2112797290	Türkiye Vakıflar Bankası T.A.O.	05/02/2025	XS2112797290	2.63%	24,000.00	98.77808	02/03/2020			100.499	8.499	204,993.84
ÖZEL SEKTÖR TAHVİL												
TRFDGOZ71915	DÜNYA GÖZ HASTANESİ	26/12/2030	TRFDGOZ71915	23.83%	17,760.00	101.65901	24/12/2021	2.08%		101.659	1	18,054.64
TRFDGOZ71915	DÜNYA GÖZ HASTANESİ	26/12/2030	TRFDGOZ71915	23.83%	-17,760.00	101.65901	24/12/2021	2.08%		101.659	1	-18,054.64
TRFDGOZ71915			TRFDGOZ71915		0.00							0.00
TRSAKYP41612	Akyürek Tüketim Ürünleri Paz.	26/12/2030	TRSAKYP41612	2.97%	342,500.00	101.35637	24/12/2021	0.17%		101.35637	1	347,145.57
TRSAKYP41612	Akyürek Tüketim Ürünleri Paz.	26/12/2030	TRSAKYP41612	2.97%	-342,500.00	101.35637	24/12/2021	0.17%		101.35637	1	-347,145.57
TRSAKYP41612			TRSAKYP41612		0.00							0.00
TRSAYNS21711	Aynes Gıda	22/02/2030	TRSAYNS21711	3.04%	-400,000.00	103.04241	24/12/2021	0.00%		103.04241	1	-412,169.64
TRSAYNS21711	Aynes Gıda	22/02/2030	TRSAYNS21711	3.04%	400,000.00	103.04241	24/12/2021	0.00%		103.04241	1	412,169.64
TRSAYNS21711			TRSAYNS21711		0							0
TRSAYNSK1619	Aynes Gıda	16/11/2030	TRSAYNSK1619	3.32%	70,000.00	100.27189	24/12/2021	0.00%		103.09665	1	72,167.65
TRSAYNSK1619	Aynes Gıda	16/11/2030	TRSAYNSK1619	3.32%	80,000.00	103.09665	24/12/2021	0.00%		103.09665	1	82,477.32
TRSAYNSK1619	Aynes Gıda	16/11/2030	TRSAYNSK1619	3.32%	-70,000.00	100.27189	24/12/2021	0.00%		103.09665	1	-72,167.65
TRSAYNSK1619	Aynes Gıda	16/11/2030	TRSAYNSK1619	3.32%	-80,000.00	103.09665	24/12/2021	0.00%		103.09665	1	-82,477.32
TRSAYNSK1619			TRSAYNSK1619		0.00							0.00
TRFFINF82115	Qnb Finans Faktoring A.Ş.	04/08/2021	TRFFINF82115	0.00%	19,000,000.00	94.436	14/04/2021	20.51%		96.78162		18,388,507.80
TRFVFAS72119	Vakıf Faktoring	01/07/2021	TRFVFAS72119	0.00%	5,880,000.00	95.412	02/04/2021	21.18%		98.43359		5,787,895.09
GRUP TOPLAMI					82,649,000.00							160,059,143.02
C. KATILMA BELGESİ												
YERLI KATILMA BELGESİ			IAG		110,000.00	1.341404	19/12/2019			1.712128		188,334.08
GRUP TOPLAMI					110,000.00							188,334.08
D. OPSİYON İŞLEMLER												
E.YABANCI HİSSE												
CPER US EQUİTY	United States Copper Index Fund		US9117181043	0.00%	83,400.00	25.64123	02/03/2021	0.00%		28.64	8.499	20,300,507.42
CPER US EQUİTY	United States Copper Index Fund		US9117181043	0.00%	79,386.00	22.24453	28/01/2021	0.00%		28.64	8.499	19,323,454.23
			US9117181043		162786							39623961.65
SPY US EQUITY	SPDR S&P 500 ETF		US78462F1030	0.00%	5,570.00	382.3599	02/02/2021	0.00%		420.335	8.499	19,898,419.31
SPY US EQUITY	SPDR S&P 500 ETF		US78462F1030	0.00%	2,250.00	382.9897	04/03/2021	0.00%		420.335	8.499	8,037,961.12
SPY US EQUITY	SPDR S&P 500 ETF		US78462F1030	0.00%	2,950.00	406.39864	05/04/2021	0.00%		420.335	8.499	10,538,660.14
			US78462F1030		10,770.00							38,475,040.57
USO US EQUITY	United States Oil Fund		US91232N2071	0.00%	75,800.00	45.10937	05/05/2021	0.00%		45.605	8.499	29,379,844.64
VWO US EQUITY	Vanguard FTSE Emerging Markets ETF		US9220428588	0	86,800.00	52.59912	05/05/2021	0		53.845	8.499	39,722,167.25
GRUP TOPLAMI					336,156.00							147,201,014.11
F.TERS REPO												
TERS REPO-DT	T.C.	01/06/2021	TRT100124T17	19.12%	3,001,571.51	137.282	31/05/2021	0.00%	2185290	137.353464		3,001,571.51
	T.C.	01/06/2021	TRT230222T13	0.19	5002602.74	256.171	31/05/2021	0	1951820	256.304513		5002602.74
	T.C.	01/06/2021	TRT100124T17	19.10%	6,003,139.73	137.282	31/05/2021	0.00%	4370570	137.353703		6,003,139.73
	T.C.	01/06/2021	TRT120325T12	19.00%	7,003,643.84	72.513	31/05/2021	0.00%	9653410	72.550983		7,003,643.84
	T.C.	01/06/2021	TRT140623T19	19.00%	15,007,808.22	101.364	31/05/2021	0.00%	14798120	101.416992		15,007,808.22

	T.C.	01/06/2021	TRT080328T15	19.25%	18,009,493.15	78.689	31/05/2021	0.00%	22874720	78.730988		18,009,493.15
	T.C.	01/06/2021	TRT180123T10	19.00%	37,019,260.27	93.636	31/05/2021	0.00%	39514610	93.684995		37,019,260.27
	T.C.	01/06/2021	TRT070727T13	0.19	43,022,383.56	164.906	31/05/2021	0	26075445	164.991944		43,022,383.56
	T.C.	01/06/2021	TRT100124T17	19.10%	44,023,024.66	137.282	31/05/2021	0.00%	32050785	137.353967		44,023,024.66
	T.C.	01/06/2021	TRT240227T17	19.00%	45,023,424.66	75.685	31/05/2021	0.00%	59457275	75.723996		45,023,424.66
	T.C.	01/06/2021	TRT060825T15	0.1906	50,026,109.59	98.748	31/05/2021	0	50633715	98.799998		50,026,109.59
	T.C.	01/06/2021	TRT181023T19	19.00%	29,015,095.89	102.992	31/05/2021	0.00%	28157425	103.045985		29,015,095.89
	T.C.	01/06/2021	TRT140623T19	19.00%	13,006,767.12	101.364	31/05/2021	0.00%	12825040	101.416971		13,006,767.12
	T.C.	01/06/2021	TRT140623T19	0.19	13006767.12	101.364	31/05/2021	0	12825040	101.416971		13006767.12
	T.C.	01/06/2021	TRT080323T10	19.00%	21,010,931.51	83.163	31/05/2021	0.00%	25251705	83.205991		21,010,931.51
	T.C.	01/06/2021	TRT110827T16	19.00%	35,018,219.18	73.209	31/05/2021	0.00%	47808405	73.246993		35,018,219.18
	T.C.	01/06/2021	TRT180123T10	19.00%	37,019,260.27	93.636	31/05/2021	0.00%	39514610	93.684995		37,019,260.27
GRUP TOPLAMI					421,219,503.02				429947985			421,219,503.02
G.KATILIM HESABI												
H.VADELİ MEVDUAT												
VADELİ DÖVİZ MEVDUATI	DENİZBANK USD	25/06/2021		1.35%	2,300,000.00	100	18/05/2021	0.00%		100.0518	8.499	19,557,817.46
	FİNANSBANK A.Ş.	25/06/2021		0.02	2300000	100	18/05/2021	0		100.0767	8.499	19562685.69
	FİNANSBANK A.Ş.	25/06/2021		1.80%	2,300,000.00	100	18/05/2021	0.00%		100.069	8.499	19,561,188.00
	FİNANSBANK A.Ş.	25/06/2021		1.40%	2,300,000.00	100	18/05/2021	0.00%		100.0537	8.499	19,558,192.02
VADELİ TL MEVDUATI	ANADOLU BANK A.	04/06/2021		19.10%	10,694,452.51	100	27/04/2021	0.00%		101.8301		10,890,169.49
GRUP TOPLAMI					19,894,452.51							89,130,052.66
I.KIYMETLİ MADEN												
KIYMETLİ MADEN			ALTIN	0.00%	62.00	449531.15	05/04/2021	0.00%		514043.57		31,870,701.48
GRUP TOPLAMI					62.00							31,870,701.48
J.YABANCI TAHVİL												
K.BORSA PARA PİYASASI												
BPP		04/06/2021		19.30%	40,909,479.45	100000	22/04/2021	21.03%		102113.4044		40,845,361.74
		01/06/2021		19.15%	836,438.61	100000	31/05/2021	0.00%		100052.4653		836,438.61
GRUP TOPLAMI					41,745,918.06							41,681,800.35
L.VARANT İŞLEMLERİ												
M.TEMİNAT İŞLEMLERİ												
VOB Nakit					38,730,095.32	1	07/07/2011			1		38,730,095.32
GRUP TOPLAMI					38,730,095.32							38,730,095.32
N.SWAP İŞLEMLERİ												
O.EUROBOND REPO												
FON												
PORTFÖY												
DEĞERİ					609,473,164.27				429947985			982,892,810.89
DÖVİZ BAKİYELERİ												
	FİNANSBANK A.Ş. VADELİ		USD		6,904,584.74						8.499	58,682,065.71
	DENİZBANK USD		USD		2,301,190.43						8.499	19,557,817.46
	FİNANS YATIRIM - VADESİZ DÖVİZ		USD		4,005,174.26						8.499	34,039,976.04
			USD		13,210,949.43							112,279,859.21
	TAKASBANK A.Ş. VADESİZ EURO		EUR		5,464.57						10.3629	56,628.79
GRUP TOPLAMI												112,336,488.00

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:				
	Tutarı	%		
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	982,892,810.89	97.14%		
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	34,103,039.93	3.37%		
C. ALACAKLAR (+) :	-	0.00%		
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	-	0.00%		
E. BORÇLAR (-) :	5,196,485.52	0.51%		
FON TOPLAM DEĞERİ:	1,011,799,365.30			
5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER				
Açıklama	Tutarı			

37001Fon Yönetim Ücreti	1,557,325.14			
37002Denetim Ücreti	1,312.54			
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	2.73			
370032O/N RRP Tahvil Borsa Payı	42,957.60			
370033Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	53,314.80			
37004Aracılık Komisyonu	150,266.57			
37005Vergi, Resim ve Harçlar	164.00			
37006Saklama Giderleri	20,300.00			
37008Banka Masrafları	12.60			
370142BİST Endeks K. Öltücü Kullanım bedeli	1,026.60			
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	141.94			
37021Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	15,731.25			
37023VOB İşlemi Komisyonu	3,572.81			
37025Döviz Alım Kambiyo Vergisi	55,225.50			
37033KAP Ücreti	402.23			
37045Fon Saklama Ücreti	61,216.14			
37056Vergi Beyannameleri Smm Ödemesi	427.75			
37098Kusürat farkları	2.76			
37099Diğer Giderler	44.25			
TOPLAM	1,963,447.21			
6. A -GEÇEN AY İÇİNDE RÜÇHAN HAKKI KULLANIMI.BEDELSİZ HİSSE SENEDİ ALIMI. TEMETTÜ VE ANAPARA TAHSİLATINA İLİŞKİN AÇIKLAMALAR				
Açıklama	Nominal Değeri			
SPY US EQUITY Tem:%87	13,870.00			
CCOLA Tem:%197	54,500.00			
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		
TRFHSBC52115	05/05/2021	20,110,000.00		
8- ÖDÜNÇ İŞLEMLERİ:	İşlem Tarihi	Vade Tarihi	Nominal Değeri	Tutar
Verilen Ödünçler				
TOPLAM :			-	0.00%
Alınan Ödünçler				
TOPLAM :			-	0.00%