

HSBC PORTFÖY BİST 30 ENDEKSİ HİSSE SENEDİ FONU HİSSE SENDİ YOĞUN FON

01/06/2017 - 30/06/2017 Tarihleri Arası Fon Raporu

I - FONU TANITICI BİLGİLER

A) FONUN ADI.....:HSBC PORTFÖY BİST 30 ENDEKSİ HİSSE SENEDİ FONU HİSSE SENDİ YOĞUN FON
 B) KURUCUNUN ÜNVANI.....:HSBC PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
 C) YÖNETİCİNİN ÜNVANI.....:HSBC PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
 D) FON PAY SAYISI.....:2,250,000,000
 E) FON TOPLAM DEĞERİ.....:9,060,587.09
 F) TEDAVÜLDEKİ PAY SAYISI.....:99,341,700
 G) FONUN KURULUŞ TARİHİ.....:04/03/1999
 H) FONUN SÜRESİ.....:Süresiz

II- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN ÖZET BİLGİLER

A) AY SONU PAY FİYATI.....:0.091206
 B) ÖNCEKİ AY PAY FİYATI.....:0.088485
 C) AYLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI.....:3.08
 D) YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI....:31.91
 E) YILLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI.....:32.36
 F) AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ
 Hisse Senetleri :96.78
 Hazine Bonosu Repo :0.00
 Devlet Tahvili Repo :2.42
 Hazine Bonosu :0.00
 Devlet Tahvili :0.00
 OTC Opsiyonlar :0.00
 Vadeli İşlemler :0.80
 Kıymetli Madenler :0.00
 Özel Sektör Tahvili :0.00
 Finansman Bonosu :0.00
 Eurobond :0.00
 Yabancı Tahvil :0.00
 Yabancı Hisse :0.00
 G) AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI :4.52
 H) AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI
 Hisse Senetleri :0.69
 Hazine Bonosu :0.00
 Devlet Tahvili :0.00
 OTC Opsiyonlar :0.00
 Vadeli İşlemler :1.00
 Kıymetli Madenler :0.00
 Özel Sektör Tahvili :0.00
 Finansman Bonosu :0.00
 Eurobond :0.00
 Yabancı Tahvil :0.00
 Yabancı Hisse :0.00
 I) PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ :0.04
 İ) KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ : 316,527
 J) KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI : 746,294

III- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	(%)
Hisse Senetleri			
Akbank	99,154	971,705.75	10.86
Akbank	344	3,371.20	.04
Anadolu Sigorta	0	1.21	.00
Arçelik	8,054	209,876.82	2.35
Arçelik	27	703.62	.01
Aselsan	6,674	145,893.64	1.63
Aselsan	23	502.78	.01
Aygaz	0	2.07	.00
BİM Birleşik Mağ.A.Ş.	8,684	566,631.00	6.33
BİM Birleşik Mağ.A.Ş.	29	1,892.25	.02
Doğan Holding	0	0.29	.00
Doğan Holding	43,813	32,421.62	.36
Emlak Konut Gayrimenkul Yat.Or	92,385	271,611.90	3.04
Emlak Konut Gayrimenkul Yat.Or	320	940.80	.01
Enka İnşaat ve San.A.Ş.	26,314	141,307.71	1.58
Enka İnşaat ve San.A.Ş.	91	488.67	.01
Ereğli Demir Çelik	80,086	564,605.89	6.31
Ereğli Demir Çelik	278	1,959.90	.02
Finansbank	0	1.90	.00
Garanti Bankası	96,104	940,853.27	10.52
Garanti Bankası	333	3,260.07	.04
T.Halk Bankası A.Ş.	29,198	383,953.70	4.29
T.Halk Bankası A.Ş.	101	1,328.15	.01
Hürriyet Gazetecilik	1	0.41	.00
T. Isbank(C)	66,500	495,428.00	5.54
T. Isbank(C)	230	1,713.50	.02
İş Gayrimenkul Yat.Ort.	1	1.97	.00
Koç Holding	26,596	430,316.99	4.81
Koç Holding	91	1,472.38	.02
Koza Altın İşletmeleri A.Ş	2,109	43,192.32	.48
Koza Altın İşletmeleri A.Ş	6	122.88	.00
Kardemir(D) Demir Çelik A.Ş.	33,103	57,929.67	.65
Kardemir(D) Demir Çelik A.Ş.	114	199.50	.00
MAVİ GİYİM	1,301	55,916.98	.63

MAVI GİYİM	5	214.90	.00
Migros Ticaret A.Ş.	1	19.73	.00
Otokar	309	34,237.20	.38
Petkim	31,463	190,665.05	2.13
Petkim	108	654.48	.01
Sabancı Holding A.Ş.	42,798	467,782.04	5.23
Sabancı Holding A.Ş.	147	1,606.71	.02
T. Şişe Cam	33,227	152,842.97	1.71
T. Şişe Cam	114	524.40	.01
ŞEKERBANK	1	0.94	.00
Sinpaş GYO	0	0.31	.00
Soda Sanayii A.Ş.	13,944	91,472.64	1.02
Soda Sanayii A.Ş.	47	308.32	.00
Tav Hava Limanları Holding A.Ş.	6,928	130,731.36	1.46
Tav Hava Limanları Holding A.Ş.	23	434.01	.00
Turkcell İletişim Hiz. A.Ş.	51,389	595,080.72	6.65
Turkcell İletişim Hiz. A.Ş.	178	2,061.24	.02
Türk Hava Yolları	32,893	264,785.65	2.96
Türk Hava Yolları	114	917.70	.01
Tekfen Holding A.Ş.	8,467	73,828.12	.83
Tekfen Holding A.Ş.	29	252.88	.00
Tofaş Oto Fabrikaları	5,721	165,343.29	1.85
Tofaş Oto Fabrikaları	19	549.10	.01
T.S.K.B.	1	1.43	.00
Türk Telekomünikasyon A.Ş.	21,690	135,345.60	1.51
Türk Telekomünikasyon A.Ş.	75	468.00	.01
Tüpraş	5,850	592,020.00	6.62
Tüpraş	19	1,922.80	.02
Ülker Gıda San.veTic.A.Ş.	6,359	141,163.45	1.58
Ülker Gıda San.veTic.A.Ş.	21	466.20	.01
T.Vakıflar Bank.T.A.O	29,795	192,771.24	2.15
T.Vakıflar Bank.T.A.O	102	659.94	.01
Yazıcılar Holding A.Ş.	0	4.56	.00
Yapı Kredi Bankası	37,301	167,482.41	1.87
Yapı Kredi Bankası	128	574.72	.01

Devlet Tahvili Repo			
TRT261022T10	8,725	12,011.64	.13
TRT261022T10	89,470	123,119.29	1.38

VOB Sözleşmeleri Uzun			
F_XU0300817	21	0.00	.00

VOB Nakit Teminatı			
VBTM-NK	0	74,615.00	.83

FON PORTFOY DEĞERİ		8,946,548.85	100.00
--------------------	--	--------------	--------

IV - FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

	TUTAR	(%)
Fon Portfoy Değeri	8,946,548.85	98.74
Nakit	40,722.88	.45
Alacaklar	158,343.66	1.75
T1 Alacaklar	0.00	.00
T2 Alacaklar	129,395.56	1.43
Temettü Alacakları	0.00	.00
Halka Arz Avansları	0.00	.00
Geçmiş Yıl Stopaj Alacağı	0.00	.00
Valörlü Döviz Tutarları	0.00	.00
Peşin Ödenen Giderler	28,948.10	.32
Vadeli İşlem Alacaklar T1	0.00	.00
Vadeli İşlem Alacaklar Tn	0.00	.00
HS. Komisyon iade	0.00	.00
Döviz İşlemler TL Yükümlülükle	0.00	.00
Ödünç İşlem Komisyon Karşılığı	0.00	.00
Opsiyon Sözleşmesi Alacakları	0.00	.00
Diğer Alacaklar	0.00	.00
Kurucudan Alacaklar	0.00	.00
Banka Faizi	0.00	.00
Ayrılan İhtiyatlar	0.00	.00
Diğer Varlıklar	0.00	.00
Borçlar	85,028.30	.94
T1 Borçlar	0.02	.00
T2 Borçlar	62,460.68	.69
Diğer Borçlar	1,545.40	.02
Ödenecek Vergi	0.00	.00
Hizmet Komisyonu	8,013.24	.09
Pay Geri Alış Borçlar	12,555.93	.14
Stopaj Gider Karşılığı	0.00	.00
SPK Kayda Alma Ücreti	453.03	.01
Vadeli İşlem Borçlar T1	0.00	.00
Vadeli İşlem Borçlar Tn	0.00	.00
VOB Nakit Borçları	0.00	.00
Opsiyon Prim Borcu T1	0.00	.00
Opsiyon Prim Borcu Tn	0.00	.00
FON TOPLAM DEĞERİ	9,060,587.09	100.00

V - AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	GİDER
Giderler	12,447.86

VIOP İŞLEMLERİ

FonKodu	Tarih	A / S	Mk Kodu	Mk Tipi	Nominal	Fiyat	Tutar
HBU	02/06/2017	Alış	F_XU0300617	VBK	8	122.2	97,760.00
HBU	05/06/2017	Alış	F_XU0300617	VBK	4	121.15	48,460.00

HBU	09/06/2017	A11\$	F_XU0300617	VBK	1	122	12,200.00
HBU	16/06/2017	A11\$	F_XU0300617	VBK	15	121.25	181,875.00
HBU	19/06/2017	A11\$	F_XU0300617	VBK	4	122.4	48,960.00
HBU	23/06/2017	A11\$	F_XU0300617	VBK	18	122.625	220,725.00
HBU	28/06/2017	A11\$	F_XU0300817	VBK	1	126.4	12,640.00
HBU	01/06/2017	A11\$	F_XU0300617	VBK	5	120.25	60,125.00
HBU	06/06/2017	A11\$	F_XU0300617	VBK	2	121.3	24,260.00
HBU	12/06/2017	A11\$	F_XU0300617	VBK	4	122.625	49,050.00
HBU	13/06/2017	A11\$	F_XU0300617	VBK	2	122.475	24,495.00
HBU	15/06/2017	A11\$	F_XU0300617	VBK	1	121.9	12,190.00
HBU	23/06/2017	A11\$	F_XU0300817	VBK	19	125.1	237,690.00
HBU	23/06/2017	A11\$	F_XU0300817	VBK	3	125.1	37,530.00

KORELASYON	3AY	0.989487522
KORELASYON	1AY	0.996227188

TARİH	HBU	BIST-30
03-Nis-17	0.078835	108,629
04-Nis-17	0.079232	108,424
05-Nis-17	0.080001	109,013
06-Nis-17	0.079731	108,526
07-Nis-17	0.079634	108,411
10-Nis-17	0.082376	112,144
11-Nis-17	0.082056	111,711
12-Nis-17	0.082107	111,770
13-Nis-17	0.081105	110,409
14-Nis-17	0.081478	110,757
17-Nis-17	0.081884	111,316
18-Nis-17	0.082590	112,282
19-Nis-17	0.082056	111,520
20-Nis-17	0.083153	113,019
21-Nis-17	0.083603	113,638
24-Nis-17	0.085203	115,401
25-Nis-17	0.086035	116,535
26-Nis-17	0.085922	116,393
27-Nis-17	0.085692	116,090
28-Nis-17	0.086102	116,665
02-May-17	0.085647	116,055
03-May-17	0.085151	115,391
04-May-17	0.084357	114,319
05-May-17	0.085222	115,502
08-May-17	0.085083	115,325
09-May-17	0.086590	117,370
10-May-17	0.087419	118,502
11-May-17	0.086332	117,035
12-May-17	0.086182	116,849
15-May-17	0.086709	117,561
16-May-17	0.087299	118,375
17-May-17	0.086824	117,751
18-May-17	0.086316	117,076
22-May-17	0.087457	118,638
23-May-17	0.088591	120,172
24-May-17	0.089183	120,989
25-May-17	0.088526	120,103
26-May-17	0.088310	119,827
29-May-17	0.088485	120,062
30-May-17	0.088142	119,550
31-May-17	0.088318	119,746
01-Haz-17	0.088184	119,560
02-Haz-17	0.089597	121,496
05-Haz-17	0.088938	120,613
06-Haz-17	0.089068	120,790
07-Haz-17	0.088536	119,966
08-Haz-17	0.088803	120,323
09-Haz-17	0.089680	121,531
12-Haz-17	0.090264	122,253
13-Haz-17	0.090073	121,969
14-Haz-17	0.090318	122,310
15-Haz-17	0.089725	121,185
16-Haz-17	0.089232	120,532
19-Haz-17	0.090298	121,984
20-Haz-17	0.090121	121,764
21-Haz-17	0.090292	121,998
22-Haz-17	0.090843	122,748
23-Haz-17	0.090486	122,293
28-Haz-17	0.091423	123,565
29-Haz-17	0.091051	123,075
30-Haz-17	0.091206	123,308