

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

01/09/2017 - 30/09/2017 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.....	:8,253,248.81
F) TEDAVÜLDEKİ PAY SAYISI.....	:88,624,400
G) FONUN KURULUŞ TARİHİ.....	:04/03/1999
H) FONUN SÜRESİ.....	:Süresiz

II- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN ÖZET BİLGİLER

A) AY SONU PAY FİYATI.....	:0.093126
B) ÖNCEKİ AY PAY FİYATI.....	:0.100216
C) AYLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI.....	:-7.07
D) YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI.....	:34.69
E) YILLIK PAY FİYATI ARTIŞ ORANI.....	:34.65
F) AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ	
Hisse Senetleri	:94.49
Hazine Bonosu Repo	:0.59
Devlet Tahvili Repo	:3.96
Hazine Bonosu	:0.00
Devlet Tahvili	:0.00
OTC Opsiyonlar	:0.00
Vadeli İşlemler	:0.96
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	:3.89
H) AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI	
Hisse Senetleri	:2.63
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	:0.14
İ) KATILMA PAYI İHRAÇLARINDAN KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ	: 943,162
J) KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI	: 698,953

III- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	(%)
Hisse Senetleri			
Akbank	87,828	825,579.89	9.97
Akbank	1,717	16,139.80	.19
Anadolu Sigorta	0	1.22	.00
Arçelik	7,133	162,052.67	1.96
Arçelik	139	3,158.08	.04
Aselsan	5,911	155,459.30	1.88
Aselsan	116	3,050.80	.04
Aygaz	0	2.00	.00
BİM Birleşik Mağ.A.Ş.	7,691	571,056.75	6.89
BİM Birleşik Mağ.A.Ş.	151	11,211.75	.14
Doğan Holding	38,674	33,646.72	.41
Doğan Holding	756	657.72	.01
Eczacıbaşı İlaç	7,080	30,444.00	.37
Emlak Konut Gayrimenkul Yat.Or	81,832	219,309.76	2.65
Emlak Konut Gayrimenkul Yat.Or	1,599	4,285.32	.05
Enka İnşaat ve San.A.Ş.	23,307	120,731.73	1.46
Enka İnşaat ve San.A.Ş.	456	2,362.08	.03
Ereğli Demir Çelik	70,938	548,350.29	6.62
Ereğli Demir Çelik	1,386	10,713.78	.13
Finansbank	0	2.09	.00
Garanti Bankası	85,126	824,014.84	9.95
Garanti Bankası	1,663	16,097.84	.19
T.Halk Bankası A.Ş.	25,862	313,447.44	3.78
T.Halk Bankası A.Ş.	506	6,132.72	.07
Hürriyet Gazetecilik	1	0.64	.00
T. Isbank(C)	58,903	399,365.07	4.82
T. Isbank(C)	1,151	7,803.78	.09
İş Gayrimenkul Yat.Ort.	1	1.85	.00
Koç Holding	23,557	385,150.59	4.65
Koç Holding	461	7,537.35	.09
Koza Anadolu Metal Madencilik	7,351	51,898.06	.63
Koza Altın İşletmeleri A.Ş.	1,867	58,250.40	.70
Koza Altın İşletmeleri A.Ş.	36	1,123.20	.01
Kardemir(D) Demir Çelik A.Ş.	29,321	66,557.91	.80
Kardemir(D) Demir Çelik A.Ş.	573	1,300.71	.02
Migros Ticaret A.Ş.	1	18.43	.00

Otokar	273	27,573.00	.33
Otokar	5	505.00	.01
Petkim	27,868	166,649.92	2.01
Petkim	545	3,259.10	.04
Pegasus Hava Taşımacılığı A.Ş.	1,540	38,376.80	.46
Sabancı Holding A.Ş.	37,908	379,838.07	4.59
Sabancı Holding A.Ş.	741	7,424.82	.09
T. Şişe Cam	32,301	132,434.97	1.60
T. Şişe Cam	632	2,591.20	.03
ŞEKERBANK	1	1.11	.00
Sinpaş GYO	0	0.32	.00
Soda Sanayii A.Ş.	0	1.02	.00
Tav Hava Limanları Holding A.Ş.	6,135	108,282.75	1.31
Tav Hava Limanları Holding A.Ş.	120	2,118.00	.03
Turkcell İletişim Hiz. A.Ş.	45,518	577,619.14	6.97
Turkcell İletişim Hiz. A.Ş.	890	11,294.10	.14
Türk Hava Yolları	29,135	254,927.99	3.08
Türk Hava Yolları	570	4,987.50	.06
Tekfen Holding A.Ş.	7,499	87,807.75	1.06
Tekfen Holding A.Ş.	147	1,721.37	.02
Tofaş Oto Fabrikaları	5,066	156,444.90	1.89
Tofaş Oto Fabrikaları	1	30.88	.00
Tofaş Oto Fabrikaları	98	3,026.24	.04
T.S.K.B.	1	1.40	.00
Türk Telekomünikasyon A.Ş.	19,212	130,449.48	1.57
Türk Telekomünikasyon A.Ş.	375	2,546.25	.03
Tüpraş	5,181	630,009.60	7.61
Tüpraş	101	12,281.60	.15
Ülker Gıda San.veTic.A.Ş.	1	13.82	.00
T.Vakıflar Bank.T.A.O	26,390	165,462.96	2.00
T.Vakıflar Bank.T.A.O	516	3,235.32	.04
Yazıcılar Holding A.Ş.	0	3.91	.00
Yapı Kredi Bankası	33,039	142,729.37	1.72
Yapı Kredi Bankası	646	2,790.72	.03
Devlet Tahvili Repo TRT050624T19	322,670	315,297.74	3.81
VOB Sözleşmeleri Uzun F_XU0301017	28	0.00	.00
VOB Nakit Teminatı VBTM-NK	0	54,180.68	.65
FON PORTFOY DEĞERİ		8,282,835.38	100.00

IV - FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU

	TUTAR	(%)
Fon Portfoy Değeri	8,282,835.38	100.36
Nakit	40,279.93	.49
Alacaklar	263,314.75	3.19
T1 Alacaklar	0.00	.00
T2 Alacaklar	244,349.65	2.96
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	18,965.10	.23
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	333,181.25	4.04
T1 Borçlar	0.02	.00
T2 Borçlar	270,385.62	3.28
Diğer Borçlar Toplam	1,883.26	.02
Diğer Borçlar	1,883.26	.02
Ayrılan İhtiyatlar	0.00	.00
Ödenecek Vergi	0.00	.00
Hizmet Komisyonu	7,177.46	.09
Pay Geri Alış Borçlar	53,322.23	.65
Stopaj Gider Karşılığı	0.00	.00
SPK Kayda Alma Ücreti	412.66	.00
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	8,253,248.81	100.00

V - AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

AÇIKLAMA	GİDER
Giderler	10,586.29

VIOP İŞLEMLER

FonKodu	Tarih	A / S	Mk Kodu	Mk Tipi	Nominal	Fiyat Tutar
HBU	05/09/2017	Alış	F_XU0301017	VBK 5	135.85	67,925.00
HBU	07/09/2017	Alış	F_XU0301017	VBK 1	136.725	13,672.50

HBU	19/09/2017	A115	F_XU0301017	VBK	1	130.4	13,040.00
HBU	22/09/2017	A115	F_XU0301017	VBK	4	129.5	51,800.00
HBU	25/09/2017	A115	F_XU0301017	VBK	4	127.65	51,060.00
HBU	27/09/2017	A115	F_XU0301017	VBK	3	125.975	37,792.50
HBU	27/09/2017	A115	F_XU0301017	VBK	1	125.975	12,597.50
HBU	27/09/2017	A115	F_XU0301017	VBK	1	125.975	12,597.50
HBU	27/09/2017	A115	F_XU0301017	VBK	7	125.975	88,182.50
HBU	27/09/2017	A115	F_XU0301017	VBK	1	125.975	12,597.50
HBU	27/09/2017	A115	F_XU0301017	VBK	3	125.975	37,792.50
HBU	28/09/2017	A115	F_XU0301017	VBK	3	127.325	38,197.50
HBU	08/09/2017	A115	F_XU0301017	VBU	1	134.9	13,490.00
HBU	08/09/2017	A115	F_XU0301017	VBU	1	134.9	13,490.00
HBU	08/09/2017	A115	F_XU0301017	VBU	1	134.9	13,490.00
HBU	08/09/2017	A115	F_XU0301017	VBU	7	134.9	94,430.00
HBU	11/09/2017	A115	F_XU0301017	VBU	11	135.95	149,545.00
HBU	14/09/2017	A115	F_XU0301017	VBU	2	134.25	26,850.00
HBU	15/09/2017	A115	F_XU0301017	VBU	1	133.75	13,375.00
HBU	18/09/2017	A115	F_XU0301017	VBU	5	132.475	66,237.50
HBU	20/09/2017	A115	F_XU0301017	VBU	9	131.05	117,945.00

KORELASYON 3AY 0.999502508
KORELASYON 1AY 0.998750701

TARİH	HBU	BİST-30
03-Tem-17	0.091228	123,343
04-Tem-17	0.091897	124,257
05-Tem-17	0.091487	123,704
06-Tem-17	0.091414	123,615
07-Tem-17	0.090894	122,924
10-Tem-17	0.091867	124,250
11-Tem-17	0.093903	127,002
12-Tem-17	0.094519	127,853
13-Tem-17	0.094780	128,210
14-Tem-17	0.095779	129,581
17-Tem-17	0.096758	130,910
18-Tem-17	0.096244	130,223
19-Tem-17	0.097955	132,534
20-Tem-17	0.097286	131,640
21-Tem-17	0.097272	131,639
24-Tem-17	0.097091	131,404
25-Tem-17	0.097289	131,676
26-Tem-17	0.097302	131,702
27-Tem-17	0.098348	133,144
28-Tem-17	0.097717	132,280
31-Tem-17	0.097546	132,065
01-Ağu-17	0.096295	130,375
02-Ağu-17	0.096549	130,724
03-Ağu-17	0.097236	131,672
04-Ağu-17	0.098615	133,555
07-Ağu-17	0.099641	134,940
08-Ağu-17	0.099519	134,782
09-Ağu-17	0.098585	133,523
10-Ağu-17	0.097694	132,334
11-Ağu-17	0.096848	131,204
14-Ağu-17	0.099253	134,439
15-Ağu-17	0.097063	131,516
16-Ağu-17	0.097060	131,510
17-Ağu-17	0.097000	131,443
18-Ağu-17	0.097273	131,837
21-Ağu-17	0.098607	133,647
22-Ağu-17	0.098497	133,514
23-Ağu-17	0.098861	133,991
24-Ağu-17	0.099087	134,318
25-Ağu-17	0.099641	135,080
28-Ağu-17	0.100216	135,876
29-Ağu-17	0.100303	136,010
31-Ağu-17	0.099867	135,427
05-Eyl-17	0.098648	133,783
06-Eyl-17	0.099346	134,732
07-Eyl-17	0.099251	134,613
08-Eyl-17	0.097954	132,869
11-Eyl-17	0.098819	134,058
12-Eyl-17	0.098515	133,656
13-Eyl-17	0.097590	132,397
14-Eyl-17	0.097758	132,637
15-Eyl-17	0.097416	131,862
18-Eyl-17	0.096482	130,596
19-Eyl-17	0.095027	128,636
20-Eyl-17	0.095462	129,211
21-Eyl-17	0.094261	127,606
22-Eyl-17	0.094435	127,860
25-Eyl-17	0.092990	125,898
26-Eyl-17	0.094457	127,894
27-Eyl-17	0.091869	124,377
28-Eyl-17	0.093058	126,005
29-Eyl-17	0.093126	126,115