

TEB Portföy PY Değişken Özel Fon
Mart 2016 Aylık Rapor

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI:	TEB Portföy PY Değişken Özel Fon
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C. YÖNETİCİ ÜNVANI:	TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D. FON TUTARI	5,000,000.00
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	5,724,577.92
F. DOLAŞIMDAKİ PAY:	5,001,706.00
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	24/07/2000
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	1.144525
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	1.128486
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	1.42%
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	2.90%
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	9.01%
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
Hisse Senedi	
Varant	
Devlet Tahvili	58.50%
Özel Sektör Tahvili	15.18%
Finansman Bonosu	
Banka Bonosu	
Hazine Bonosu	
Devlet Tahvili Repo	5.58%
Kuponlar Repo	
Hazine Bonosu Repo	
Varlığa Dayalı Menkuller	
Kira Sertifikaları	
Katılım Hesabı	
Katılma Belgesi	
GES	
GOS	
Borsa Para Piyasası	16.52%
Kıymetli Madenler	
VOB İşlemleri	
VOB Nakit Teminat İşlemleri	0.80%
Yabancı Sabit Getirili	
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	
Opsiyon	
Swap	
Yabancı Hisse Senetleri	
Vadeli Mevduat TL	3.43%
Vadeli Mevduat Döviz	
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	0.47%
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse Senedi	0.00%
Devlet Borçlanma Senetleri	85.29%
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	491.362
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:	0

T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN
KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI: 831,613.60

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) VARANTLAR:			
C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:			
TRT080317T18	1,200,000.00	1,197,736.52	20.93%
TRT080720T19	24,990.00	25,325.39	0.44%
TRT130716T18	300,000.00	303,881.61	5.31%
TRT140218T10	800,000.00	760,541.49	13.29%
TRT140617T17	700,000.00	718,408.75	12.56%
TRT210721T11	400,000.00	592,170.02	10.35%
TOPLAM :	3,424,990.00	3,598,063.78	62.88%
D) BANKA BONOLARI:			
E) FİNANSMAN BONOLARI:			
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:			
TRSLBTVK1711	300,000.00	309,119.79	5.40%
TRSMDBK61619	400,000.00	398,932.41	6.97%
TRSYDAT61625	200,000.00	200,180.56	3.50%
TOPLAM :	900,000.00	908,232.76	15.87%
G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:			
H) GELİRE ENDEKSLİ SENETLER:			
I) KİRA SERTİFİKALARI:			
J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:			
K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:			
L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:			
M) KATILIM HESAPLARI:			
N) KATILMA BELGELERİ:			
O) VOB İŞLEMLERİ:			
F_TRYUSD0416S0	100	2.85	0.00%
F_XU0300416S0	-30	101.97	0.00%
TOPLAM :	70	104.82	0.00%
P) OPSİYON İŞLEMLERİ:			
R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:			
TL	50,032.78	50,032.78	0.87%
TOPLAM :	50,032.78	50,032.78	0.87%
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:			
T) DİĞER:			
VL Vadeli Mevduat TL	71,253.98	70,610.88	1.23%
VL Vadeli Mevduat TL	52,211.90	51,885.05	0.91%
VL Vadeli Mevduat TL	52,149.65	51,805.31	0.91%
BPP	50,730.14	50,676.21	0.89%
BPP	80,303.78	80,303.78	1.40%
BPP	80,441.86	80,309.36	1.40%
BPP	80,414.25	80,303.38	1.40%

BPP	50,671.51	50,201.83	0.88%
BPP	150,200.55	150,200.55	2.63%
BPP	100,168.49	100,062.00	1.75%
BPP	100,068.49	100,068.49	1.75%
BPP	299,104.04	299,104.04	5.23%
TOPLAM :	1,167,718.64	1,165,530.88	20.37%
FON PORTFÖY DEĞERİ	5,542,741.42	5,721,860.20	

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:

	Tutarı	%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	5,721,860.20	99.95%
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	9,471.62	0.17%
C. ALACAKLAR (+) :	0	0.00%
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	2,330.04	0.04%
E. BORÇLAR (-) :	9,083.94	0.16%
FON TOPLAM DEĞERİ:	5,724,577.92	

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001Fon Yönetim Ücreti	3,896.13
37002Denetim Ücreti	575.05
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	57.29
370032O/N RRP Tahvil Borsa Payı	83.93
370033Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	56.7
37006Saklama Giderleri	151.59
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	328.42
37021Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	286.23
37023VOB İşlemi Komisyonu	165.08
37042Borsa Payı BSMV Karsılığı	129.55
37045Fon Saklama Ücreti	208.3
37099Diğer Giderler	597.51
TOPLAM	6,535.78