

TEB Portföy Birinci Değişken Fon  
Mart 2016 Aylık Rapor

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI:	TEB Portföy Birinci Değişken Fon
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C. YÖNETİCİ ÜNVANI	TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D. FON TUTARI	400,000.00
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	5,499,747.71
F. DOLAŞIMDAKİ PAY:	1,844,747.00
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	21/11/1995
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	2.981302
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	2.831564
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	5.29%
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	7.51%
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	3.52%
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
Hisse Senedi	42.63%
Varant	
Devlet Tahvili	23.85%
Özel Sektör Tahvili	18.45%
Finansman Bonosu	
Banka Bonosu	
Hazine Bonosu	
Devlet Tahvili Repo	11.97%
Kuponlar Repo	
Hazine Bonosu Repo	
Varlığa Dayalı Menkuller	
Kira Sertifikaları	
Katılım Hesabı	
Katılma Belgesi	
GES	
GOS	
Borsa Para Piyasası	
Kıymetli Madenler	
VOB İşlemleri	
VOB Nakit Teminat İşlemleri	2.22%
Yabancı Sabit Getirililer	
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	
Opsiyon	
Swap	
Yabancı Hisse Senetleri	
Vadeli Mevduat TL	0.88%
Vadeli Mevduat Döviz	
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	4.63%
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse Senedi	86.29%
Devlet Borçlanma Senetleri	29.51%
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	1,002.01
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:	272,662.09
T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN	

KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:

518,575.95

## 3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
<b>A) HİSSE SENETLERİ</b>			
AKBNK	17,000.00	136,340.00	2.49%
AKCNS	6,150.00	88,375.50	1.61%
AKSEN	16,850.00	45,663.50	0.83%
ANHYT	8,000.00	44,720.00	0.82%
ARCLK	3,600.00	68,976.00	1.26%
AYGAZ	3,950.00	48,190.00	0.88%
BIMAS	2,450.00	149,572.50	2.73%
CIMSA	4,100.00	64,534.00	1.18%
FROTO	4,350.00	161,559.00	2.95%
GARAN	46,250.00	381,100.00	6.95%
HALKB	2,250.00	23,557.50	0.43%
INDES	9,000.00	75,150.00	1.37%
ISCTR	19,000.00	88,540.00	1.61%
SODA	14,250.00	72,532.50	1.32%
TAVHL	6,850.00	115,148.50	2.10%
THYAO	12,000.00	93,480.00	1.70%
TRGYO	11,500.00	50,830.00	0.93%
TTKOM	17,650.00	117,902.00	2.15%
TTRAK	1,150.00	96,542.50	1.76%
TUPRS	3,225.00	255,903.75	4.67%
ULKER	5,500.00	114,950.00	2.10%
VAKBN	10,250.00	48,277.50	0.88%
<b>TOPLAM :</b>	<b>225,325.00</b>	<b>2,341,844.75</b>	<b>42.71%</b>
<b>B) VARANTLAR:</b>			
<b>C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:</b>			
TRT140617T17	100,000.00	102,629.82	1.87%
TRT200324T13	600,000.00	622,536.37	11.35%
TRT240724T15	300,000.00	291,784.20	5.32%
<b>TOPLAM :</b>	<b>1,000,000.00</b>	<b>1,016,950.39</b>	<b>18.55%</b>
<b>D) BANKA BONOLARI:</b>			
<b>E) FİNANSMAN BONOLARI:</b>			
<b>F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:</b>			
TRSAYGZ11810	200,000.00	204,372.79	3.73%
TRSBEDS41611	300,000.00	308,452.36	5.63%
TRSRNSH71616	150,000.00	155,174.93	2.83%
TRSZORN81616	250,000.00	254,629.65	4.64%
<b>TOPLAM :</b>	<b>900,000.00</b>	<b>922,629.73</b>	<b>16.83%</b>
<b>G) GELİR ORTAKLIĞI SENETLERİ:</b>			
<b>H) GELİRE ENDEKSLİ SENETLER:</b>			
<b>I) KİRA SERTİFİKALARI:</b>			
<b>J) VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER:</b>			
<b>K) YABANCI MENKUL KIYMETLER:</b>			
<b>L) ALTIN VE DİĞER KIYMETLİ MADENLER:</b>			
<b>M) KATILIM HESAPLARI:</b>			
<b>N) KATILMA BELGELERİ:</b>			
<b>O) VOB İŞLEMLERİ:</b>			
F_XU0300416S0	-52	101.97	0.00%

TOPLAM :	-52	101.98	0.00%
P) OPSİYON İŞLEMLERİ:			
R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:			
TL	110,804.43	110,804.43	2.02%
TOPLAM :	110,804.43	110,804.43	2.02%
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:			
T) DİĞER:			
VL Vadeli Mevduat TL	101,189.07	100,555.63	1.83%
RRP TRT230222T13	426,110.88	426,110.88	7.77%
RRP TRT230222T13	64,016.18	64,016.18	1.17%
RRP TRT230222T13	500,139.86	500,139.86	9.12%
TOPLAM :	1,091,455.99	1,090,822.55	19.89%
FON PORTFÖY DEĞERİ	3,327,585.42	5,483,051.85	

#### 4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:

	Tutarı	%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	5,483,051.85	99.70%
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	11,506.45	0.21%
C. ALACAKLAR (+) :	20,187.75	0.37%
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	2,330.04	0.04%
E. BORÇLAR (-) :	17,328.38	0.32%
FON TOPLAM DEĞERİ:	5,499,747.71	

#### 5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001Fon Yönetim Ücreti	14,160.45
37002Denetim Ücreti	575.05
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	10.18
370032O/N RRP Tahvil Borsa Payı	179.61
370033Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	68.79
37004Aracılık Komisyonu	1,158.94
37006Saklama Giderleri	84.63
37021Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	275.01
37023VOB İşlemi Komisyonu	163.08
37045Fon Saklama Ücreti	186.33
37099Diğer Giderler	302.08
TOPLAM	17,164.15