

TEB Porföy Üçüncü Değişken Fon
Mart 2016 Aylık Rapor

1- FONU TANITICI BİLGİLER

A. FONUN ADI:	TEB Porföy Üçüncü Değişken Fon
B. KURUCUNUN ÜNVANI:	TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
C. YÖNETİCİ ÜNVANI:	TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.
D. FON TUTARI	500,000,000.00
E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ:	31,752,361.52
F. DOLAŞIMDAKİ PAY:	661,202,481.00
G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:	21/10/2002
H. FONUN SÜRESİ:	SÜRESİZ

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI	0.048022
B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:	0.047611
C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	0.86%
D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:	2.17%
E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:	7.82%
F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:	
Hisse Senedi	2.12%
Varant	
Devlet Tahvili	49.37%
Özel Sektör Tahvili	8.40%
Finansman Bonosu	9.59%
Banka Bonosu	
Hazine Bonosu	
Devlet Tahvili Repo	2.59%
Kuponlar Repo	
Hazine Bonosu Repo	
Varlığa Dayalı Menkuller	
Kira Sertifikaları	
Katılım Hesabı	
Katılma Belgesi	
GES	
GOS	
Borsa Para Piyasası	18.85%
Kıymetli Madenler	
VOB İşlemleri	
VOB Nakit Teminat İşlemleri	2.35%
Yabancı Sabit Getirililer	
Euro Bond (Euro Tahvil Turk)	
Opsiyon	
Swap	
Yabancı Hisse Senetleri	
Vadeli Mevduat TL	6.74%
Vadeli Mevduat Döviz	
G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:	1.34%
H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:	
Hisse Senedi	348.91%
Devlet Borçlanma Senetleri	36.47%
I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:	199.813
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:	117,487.02
T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:	1,062,683.46

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:

	Nominal Değeri	Rayiç Değeri	%
A) HİSSE SENETLERİ			
B) VARANTLAR:			
C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:			
TRT040516T11	100,000.00	149,616.98	0.47%
TRT080317T18	3,000,000.00	2,994,341.31	9.42%
TRT130716T18	2,000,000.00	2,025,877.40	6.38%
TRT141216T10	2,000,000.00	1,867,617.76	5.88%
TRT161116T19	5,000,000.00	5,101,400.35	16.05%
TRT161116T19	3,000,000.00	3,060,840.21	9.63%
TOPLAM :	15,100,000.00	15,199,694.01	47.84%
D) BANKA BONOLARI:			
E) FİNANSMAN BONOLARI:			
TRFAKFK81615	1,000,000.00	961,925.75	3.03%
TRFYKFK71616	1,000,000.00	967,339.34	3.04%
TOPLAM :	2,000,000.00	1,929,265.09	6.07%
F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:			
TRSAYGZ11810	800,000.00	817,491.15	2.57%
TRSGFYH81711	370,000.00	377,451.94	1.19%
TRSKCTF51717	960,000.00	978,963.40	3.08%
TRSYDATA1711	1,000,000.00	1,001,375.34	3.15%
TOPLAM :	3,130,000.00	3,175,281.83	9.99%
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_XU0300416S0	-157	101.97	0.00%
TOPLAM :	-157	101.98	0.00%
P) OPSİYON İŞLEMLERİ:			
R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:			
TL	688,475.44	688,475.44	2.17%
TOPLAM :	688,475.44	688,475.44	2.17%
S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:			
T) DİĞER:			
VL Vadeli Mevduat TL	667,777.11	661,751.15	2.08%
VL Vadeli Mevduat TL	684,964.99	680,677.11	2.14%
VL Vadeli Mevduat TL	673,861.50	669,412.08	2.11%
VL Vadeli Mevduat TL	658,329.23	652,368.97	2.05%
RRP TRT190521T17	2,000,559.45	2,000,559.45	6.30%
BPP	1,016,804.11	1,013,393.61	3.19%
BPP	1,012,821.92	1,012,821.92	3.19%
BPP	1,013,279.45	1,010,933.92	3.18%
BPP	1,014,771.23	1,006,194.67	3.17%

BPP	1,014,498.63	1,003,518.43	3.16%
BPP	1,070,376.70	1,070,376.70	3.37%
TOPLAM :	10,828,044.32	10,782,008.01	33.93%

FON PORTFÖY DEĞERİ 31,746,519.76 31,774,724.38

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:

	Tutarı	%
A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:	31,774,724.38	100.07%
B. HAZIR DEĞERLER (+) :	26,106.36	0.08%
C. ALACAKLAR (+) :	0	0.00%
D. DİĞER VARLIKLAR (+) :	2,330.04	0.01%
E. BORÇLAR (-) :	50,799.26	0.16%
FON TOPLAM DEĞERİ:	31,752,361.52	

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

Açıklama	Tutarı
37001Fon Yönetim Ücreti	40,768.96
37002Denetim Ücreti	575.05
370031SGMK Tahvil Borsa Payı	132.92
370032O/N RRP Tahvil Borsa Payı	213.15
370033Vadeli RRP Tahvil Borsa Payı	110.37
37004Aracılık Komisyonu	2,482.54
37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu	797.16
37021Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti	1,587.68
37023VOB İşlemi Komisyonu	164.63
37042Borsa Payı BSMV Karsılığı	307.29
37045Fon Saklama Ücreti	1,089.78
37099Diğer Giderler	597.51
TOPLAM	48,827.04