

TEB YATIRIM M.DEĞERLER A.Ş. B TİPİ DEĞİŞKEN FONU  
Mart 2016 Aylık Rapor

1- FONU TANITICI BİLGİLER

|                                    |  |
|------------------------------------|--|
| A. FONUN ADI:                      | TEB YATIRIM M.DEĞERLER A.Ş. B TİPİ DEĞİŞKEN FONU |
| B. KURUCUNUN ÜNVANI:               | TEB YATIRIM.DEĞERLER A.Ş.                        |
| C. YÖNETİCİ ÜNVANI                 | TEB PORTFÖY YÖNETİMİ A.Ş.                        |
| D. FON TUTARI                      | 6,485,000.00                                     |
| E. TOPLAM DEĞER/NET VARLIK DEĞERİ: | 2,847,182.60                                     |
| F. DOLAŞIMDAKİ PAY:                | 4,414,966.00                                     |
| G.FONUN KURULUŞ TARİHİ:            | 02/06/1997                                       |
| H. FONUN SÜRESİ:                   | SÜRESİZ  |

2- FONUN PERFORMANSINA İLİŞKİN BİLGİLER

|   |            |
|---|------------|
| A. AY SONU KATILMA PAYI FİYATI                                | 0.644893   |
| B. ÖNCEKİ AY KATILMA PAYI FİYATI:                             | 0.638826   |
| C. AYLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:                     | 0.95%      |
| D. YILBAŞINA GÖRE FİYAT ARTIŞ ORANI:                          | 2.23%      |
| E. YILLIK KATILMA PAYI FİYATI ARTIŞ ORANI:                    | 6.76%      |
| F. AYLIK ORTALAMA PORTFÖYDEKİ<br>MENKUL KIYMETLER YÜZDESİ:    |            |
| Hisse Senedi  |            |
| Varant  |            |
| Devlet Tahvili  | 97.23%     |
| Özel Sektör Tahvili   |            |
| Finansman Bonosu  |            |
| Banka Bonosu  |            |
| Hazine Bonosu   |            |
| Devlet Tahvili Repo   |            |
| Kuponlar Repo   |            |
| Hazine Bonosu Repo  |            |
| Varlığa Dayalı Menkuller                                      |            |
| Kira Sertifikaları  |            |
| Katılım Hesabı  |            |
| Katılma Belgesi   |            |
| GES   |            |
| GOS   |            |
| Borsa Para Piyasası   | 2.77%      |
| Kıymetli Madenler   |            |
| VOB İşlemleri   |            |
| VOB Nakit Teminat İşlemleri                                   |            |
| Yabancı Sabit Getirililer                                     |            |
| Euro Bond (Euro Tahvil Türk)                                  |            |
| Opsiyon   |            |
| Swap  |            |
| Yabancı Hisse Senetleri                                       |            |
| Vadeli Mevduat TL   |            |
| Vadeli Mevduat Döviz  |            |
| G. AYLIK ORTALAMA TEDAVÜL ORANI:                              | 1.04%      |
| H. AYLIK ORTALAMA PORTFÖY DEVİR HIZI:                         |            |
| Hisse Senedi  | 0.00%      |
| Devlet Borçlanma Senetleri                                    | 3.62%      |
| I. PORTFÖYÜN ORTALAMA VADESİ:                                 | 238.994    |
| 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<br>KAYNAKLANAN NAKİT GİRİŞLERİ: | 0          |
| T. KATILMA PAYI İADELERİNDEN<br>KAYNAKLANAN NAKİT ÇIKIŞLARI:  | 190,086.13 |

3- FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU:

|                    | Nominal Değeri | Rayiç Değeri | % |
|--------------------|----------------|--------------|---|
| A) HİSSE SENETLERİ |                |              |   |

B) VARANTLAR:

C) DEVLET TAHVİLİ VE HAZİNE BONOLARI:

|              |              |              |        |
|--------------|--------------|--------------|--------|
| TRT130716T18 | 700,000.00   | 709,057.09   | 24.92% |
| TRT140617T17 | 500,000.00   | 513,149.11   | 18.03% |
| TRT141216T10 | 800,000.00   | 747,047.10   | 26.25% |
| TRT161116T19 | 800,000.00   | 816,224.06   | 28.68% |
| TOPLAM :     | 2,800,000.00 | 2,785,477.36 | 97.89% |

D) BANKA BONOLARI:

E) FİNANSMAN BONOLARI:

F) ÖZEL SEKTÖR TAHVİLLERİ:

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:

P) OPSİYON İŞLEMLERİ:

R) VOB NAKİT TEMİNAT İŞLEMLERİ:

S) DÖVİZE ENDEKSLİ TAHVİLLER:

T) DİĞER:

|          |           |           |       |
|----------|-----------|-----------|-------|
| BPP      | 60,021.12 | 60,021.12 | 2.11% |
| TOPLAM : | 60,021.12 | 60,021.12 | 2.11% |

FON PORTFÖY DEĞERİ

2,860,021.12 2,845,498.48

4- FON TOPLAM DEĞERİ TABLOSU:

|                                | Tutarı       | %      |
|--------------------------------|--------------|--------|
| A. FON PORTFÖY DEĞERİ TABLOSU: | 2,845,498.48 | 99.94% |
| B. HAZİR DEĞERLER (+) :        | 10,327.54    | 0.36%  |
| C. ALACAKLAR (+) :             | 0            | 0.00%  |
| D. DİĞER VARLIKLAR (+) :       | 2,017.72     | 0.07%  |
| E. BORÇLAR (-) :               | 10,661.14    | 0.37%  |
| FON TOPLAM DEĞERİ:             | 2,847,182.60 |        |

5- AY İÇİNDE YAPILAN GİDERLER

| Açıklama                                   | Tutarı   |
|--|----------|
| 37001Fon Yönetim Ücreti                    | 6,239.11 |
| 37002Denetim Ücreti                        | 1,116.62 |
| 370031SGMK Tahvil Borsa Payı               | 1.52     |
| 37006Saklama Giderleri                     | 4.65     |
| 37015Bankalararası Para Piyasası Komisyonu | 44.72    |
| 37021Ödenen SPK Kayda Alma Ücreti          | 142.37   |
| 37042Borsa Payı BSMV Karsılığı             | 8.09     |
| 37099Diğer Giderler                        | 448.48   |
| TOPLAM                                     | 8,005.56 |